



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Janeiro/2025

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 – JANEIRO 2025



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Límite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Duration DC:		2,085,22	
PL:	5.034.979.374,07	VAR / PL:	1,6593%	Status:		Duration DU:			
VAR:	83.546.823,49	VAR / CDI:	0,0186%	Benchmark:					1.429,13
ETL:	104.771.087,24								

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	147.934.684,32	Cenário Baixa - 10000 (-):	174.989.807,36	CENARIO BRADESCO 1 (+):	330.945.506,02	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.283.603.514,06
Cenário Alta - 09999 (-):	-175.216.214,25	Cenário Baixa - 10000 (-):	-172.638.790,09	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-74.541.270,12	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-1.554.667.242,14
Cenário Alta - 09999:	-27.281.529,93	Cenário Baixa - 10000:	2.351.017,27	CENARIO BRADESCO 1:	256.404.235,90	CENARIO BRADESCO 2:	-271.063.728,08

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	377.391,59	20.430,32	16.103,29	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
17H0164854	5.736.331,75	113.796,68	69.290,04	0,08%	-117.243,68	66.570,54	78.301,57	-104.075,18
ABEV3	5.072.555,70	656.831,52	-33.324,78	-0,04%	710.157,80	-1.521.766,71	743.636,67	-749.723,73
AEGP23	7.696.223,03	29.506,91	8.398,05	0,01%	-6.663,79	94.660,71	32.970,18	-44.516,83
AEGPA1	1.914.513,44	2.415,33	2.020,76	0,00%	-3.612,20	2.960,13	6.368,37	-8.776,23
AEC11	2.829.917,75	374.599,56	15.176,16	0,02%	1.414.958,88	-1.414.958,88	414.855,94	-418.261,84
ALOS3	5.179.495,00	583.679,07	513.702,58	0,61%	0,00	0,00	759.313,97	-765.529,36
ALPA4	1.166.840,00	103.665,52	10.496,11	0,01%	291.710,00	-291.710,00	171.058,74	-172.458,95
AMOB3	9.406,95	27.486,08	-22.411,63	-0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
APPSA2	2.319.412,82	67.506,22	63.988,12	0,08%	-226.381,63	-36.599,62	91.955,27	-118.280,06
APRB28	895.297,95	85,06	68,20	0,00%	-133,08	108,19	252,53	-364,24
ARTRA1	2.629.384,16	271,65	216,94	0,00%	-438,77	357,82	851,33	-1.234,89
ASAB11	1.488.889,25	43.227,13	40.452,19	0,05%	-142.117,81	-24.679,76	57.443,75	-73.469,61
ASAJ3	2.050.489,98	576.769,41	495.630,47	0,59%	574.137,19	-533.127,40	300.601,83	-303.062,42
ASER12	2.353.545,52	104.761,62	100.399,76	0,12%	-363.323,58	-13.010,37	207.364,57	-246.399,07
AURE3	145.590,72	14.042,33	4.283,32	0,01%	43.675,42	-45.134,92	21.343,60	-21.518,31
AZUL4	83.388,80	36.378,86	25.845,52	0,03%	50.033,28	-29.186,08	12.224,80	-12.224,87
AZZA3	3.784.775,20	1.019.367,27	847.310,53	1,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
B3SA3	5.791.183,08	609.127,28	139.159,69	0,17%	1.447.795,77	-1.447.795,77	848.987,44	-855.936,86
BARU11	1.474.557,77	70.075,50	70.075,50	0,08%	-248.329,76	-15.082,49	136.717,91	-162.425,17
BBAS3	9.963.858,88	1.476.979,24	1.018.198,37	1,22%	2.490.964,72	-2.491.000,72	1.460.701,71	-1.472.658,34
BBDC3	907.056,20	105.279,80	69.766,12	0,08%	226.764,05	-226.764,05	132.974,44	-134.062,91
BBDC4	5.275.217,61	702.173,56	520.003,88	0,62%	1.318.804,40	-1.318.848,04	773.346,90	-779.671,16
BBSE3	2.417.768,36	146.452,15	14.921,33	0,02%	483.553,67	-483.553,67	354.444,84	-357.346,16
BBTOPIND	255.639.183,87	5.017.855,82	4.848.534,23	5,80%	0,00	0,00	0,00	0,00
BCBF14	88.796,59	0,36	0,16	0,00%	-1,22	1,24	4,67	-7,07
BCBF15	1.011.795,36	10,12	7,91	0,00%	-32,14	32,85	100,69	-151,75
BEF3	70.121,92	10.699,73	3.669,16	0,00%	17.530,48	-17.530,48	10.279,87	-10.364,02
BMLC11	3.657.177,54	90.861,04	7.416,76	0,01%	3.657.177,54	-3.657.177,54	536.142,23	-540.530,84
BPAC11	6.750.132,50	1.383.663,41	1.189.967,28	1,42%	2.025.039,75	-2.362.546,38	989.569,43	-997.669,58
BPML11	4.938.044,80	540.827,61	214.312,12	0,26%	4.938.044,80	-4.938.044,80	723.917,37	-729.343,02
BRAP4	231.684,75	17.887,84	12.705,60	0,02%	57.921,19	-57.922,58	33.964,98	-34.243,01
BRAV3	573.086,50	100.379,15	-39.559,18	-0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRCR11	469.295,00	23.677,67	313,25	0,00%	122.016,70	-122.016,70	68.798,65	-69.361,80
BRFS3	1.629.907,51	380.666,38	-123.121,77	-0,15%	407.476,88	-407.476,88	238.944,44	-240.900,33
BRKM5	203.241,77	74.497,55	54.321,23	0,07%	111.782,97	-60.972,53	29.795,24	-30.039,13
BRKP28	4.995.745,60	187.308,51	176.514,07	0,21%	-648.399,37	-92.559,79	298.149,91	-373.219,34
BRKPA0	2.860.177,72	1.235,61	991,72	0,00%	-1.903,26	1.540,04	3.574,03	-5.143,44
CAEC11	1.937.012,88	32,59	25,92	0,00%	-71,24	62,31	171,24	-255,27
CAEC21	4.195.490,46	119.542,10	93.776,52	0,11%	-250.172,36	-20.485,68	100.337,87	-132.083,07
CAIXA	57.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	6.127.481,92	197.001,68	184.150,77	0,22%	-600.480,55	-40.318,31	291.083,51	-366.591,27
CSAN22	7.569.322,55	147.082,26	124.707,02	0,15%	-202.345,41	165.460,33	332.074,36	-438.184,80
CBOP11	34.750,54	2.927,72	-545,53	0,00%	17.375,27	-17.375,27	5.094,43	-5.136,13
CCRO3	617.694,92	92.295,68	74.936,62	0,09%	154.423,73	-154.423,73	90.554,08	-91.295,31
CDB323R5ITI	7.113.823,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEAB13	1.493.868,78	658,13	528,86	0,00%	-990,51	798,15	1.809,77	-2.584,68
CEEBA3	1.897.089,17	239,18	190,48	0,00%	-398,40	325,43	786,56	-1.148,49
CEOC11	482.842,50	27.300,36	14.316,64	0,02%	241.419,98	-241.421,25	70.784,71	-71.364,12
CGBP13	4.335.797,62	3.364,67	2.819,40	0,00%	-5.064,77	4.159,06	9.026,36	-12.429,43
CJEN13	3.935.525,32	126.175,84	117.053,20	0,14%	-368.680,71	-11.474,85	187.412,88	-235.226,17
CLH12	2.478.024,97	6.744,65	5.874,81	0,01%	-10.679,49	8.961,78	18.873,36	-24.854,53
CMDD33	763.579,46	1.555,91	-55,13	0,00%	-3.798,46	-2.850,54	-42,71	57,96
CMG4	1.601.102,56	109.183,12	29.485,21	0,04%	400.275,64	-480.330,77	234.721,64	-236.642,96
CMNS3	498.492,54	68.471,06	30.636,60	0,04%	174.472,39	-174.472,39	73.079,01	-73.677,20
CSMG22	2.733.056,61	75.485,12	65.190,60	0,08%	-197.918,25	-24.055,61	79.040,82	-103.098,72
CNRD11	5.900.143,85	209.984,38	194.637,61	0,23%	-608.030,00	-5.042,30	325.615,58	-405.712,51
COGN3	146.397,48	49.490,49	39.240,43	0,05%	36.599,37	-51.239,12	21.461,87	-21.637,55
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	4.042.235,01	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	1.110.920,94	96.068,49	73.472,21	0,09%	222.184,19	-222.184,19	162.861,01	-164.194,12
CPLE3	4.254.056,88	324.346,49	225.151,27	0,27%	935.843,45	-935.892,51	623.644,74	-628.749,61
CPLE6	7.504.434,10	591.421,72	447.155,78	0,54%	1.650.975,50	-1.650.975,50	1.100.150,04	-1.109.155,36
CPTI2	1.677.584,41	1.891,60	1.630,98	0,00%	-2.946,83	2.456,78	5.198,11	-6.925,38
CRFB3	182.821,65	41.764,90	30.386,88	0,04%	45.705,41	-45.705,41	26.801,65	-27.021,04
CRMG15	2.797.358,36	68.562,12	61.010,54	0,07%	-183.956,29	-6.407,58	84.040,87	-108.853,45
CRTR12	2.782.044,00	114.367,53	109.053,98	0,13%	-379.946,46	-11.204,04	212.325,89	-256.003,09
CSAN23	1.142.282,35	2.338,18	2.040,14	0,00%	-3.687,47	3.096,26	6.480,51	-8.900,72
CSAN3	493.935,84	63.052,67	51.580,35	0,06%	123.463,96	-123.463,96	72.410,99	-73.003,72
CSMG8	2.733.056,61	75.485,12	65.190,60	0,08%	-197.918,25	-24.055,61	79.040,82	-103.098,72
CSMG9	3.184.048,42	101.622,47	95.824,24	0,11%	-323.535,15	-38.404,57	144.628,91	-183.555,09
CSMG3	2.771.733,61	10.626,69	3.024,49	0,00%	-2.399,91	34.091,33	11.873,96	-16.032,40
CSNA3	366.617,88	96.162,63	60.645,24	0,07%	146.643,12	-109.989,40	53.746,18	-54.186,12
CVCB3	56.275,02	26.835,08	23.922,89	0,03%	28.137,51	-28.137,51	8.249,92	-8.317,45
CXSE3	974.693,28	94.082,10	27.745,09	0,03%	194.938,66	-194.938,66	142.890,04	-144.059,67
CYRE3	130.168,26	69.012,81	57.426,08	0,07%	99.253,84	-89.950,31	45.470,67	-45.842,87
DAPK25	-4.915,03	33.225,87	-18.318,64	-0,02%	-63.290,99	60.178,79	19.816,28	-19.908,89
DAPK27	-15.835,78	665.052,41	483.778,70	0,58%	-907.193,56	832.567,02	975.434,85	-955.770,28
DAPK29	-4.916,16	176.644,08	157.161,82	0,19%	-309.497,45	281.687,51	368.597,20	-351.875,36
DAPK35	8.416,78	39.321,68	-33.382,69	-0,04%	107.039,34	-100.204,04	-148.122,84	130.594,65
DAPQ26	9.915,81	340.018,62	221.701,07	0,27%	-539.466,43	508.024,67	524.702,53	-518.639,08
DAPQ28	-30.594,99	1.279.850,77	1.071.492,74	1,28%	-1.908.995,06	1.732.903,21	2.200.833,41	-2.120.790,02
DAPQ30	12.973,69	130.631,78	-122.920,01	-0,15%	305.148,08	-276.807,98	-380.664,75	357.285,69
DAPQ32	14.605,18	127.288,68	-117.857,94	-0,14%	337.929,87	-307.581,84	-445.885,04	407.279,19
DASAC5	1.969.843,91	5.439,65	4.841,89	0,01%	-8.994,06	7.655,68	15.919,11	-20.366,77
DHF26	6.919,54	199.227,04	-154.509,77	-0,18%	321.364,95	-256.391,96	-603.716,48	882.024,06

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Límite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Duration DC:		2,085,22	
PL:	5.034.979.374,07	VAR / PL:	1,6593%	Status:		Duration DU:			1,429,13
VAR:	83.546.823,49	ETL:	2,0809%	Benchmark:					
ETL:	104.771.087,24	VAR / CDI:	0,0186%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	147.934.684,32	Cenário Baixa - 10000 (-):	174.989.807,36	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	330.945.506,02	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	1.283.603.514,06			
Cenário Alta - 09999 (-):	-175.216.214,25	Cenário Baixa - 10000 (-):	-172.638.790,09	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-74.541.270,12	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-1.554.667.242,14			
Cenário Alta - 09999:	-27.281.529,93	Cenário Baixa - 10000:	2.351.017,27	CENÁRIO BRADESCO 1:	256.404.235,90	CENÁRIO BRADESCO 2:	-271.063.728,08			

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
DHF27	-2.869,94	157.306,62	126.705,36	0,15%	-217.476,43	174.585,92	377.451,03	-527.494,23
DHF28	2.838,67	214.771,43	181.114,54	0,22%	-305.043,78	252.060,77	520.114,52	-696.248,92
DHF29	-5.969,39	154.624,32	-136.955,93	-0,16%	238.273,61	-202.298,67	-411.611,68	528.074,02
DHF31	-2.325,10	26.698,55	-24.888,21	-0,03%	51.024,76	-45.099,68	-91.995,40	108.283,99
DH125	49,65	4.220,15	-1.502,79	0,00%	4.219,51	-4.302,68	-18.932,33	28.814,78
DH125	14,54	3.487,63	-741,84	0,00%	6.979,18	-7.103,58	-31.346,68	47.559,48
DH125	99,88	168.319,00	124.757,39	0,15%	-411.678,81	418.369,23	-1.257.837,92	-2.312.337,38
DH126	19.423,57	537.873,12	-426.359,05	-0,51%	754.858,65	-597.202,00	-1.357.061,70	1.938.916,66
DIR3	1.292.222,00	198.160,27	173.394,11	0,21%	387.666,60	-387.666,60	189.439,75	-190.990,41
DOLH25	27.331,36	541.193,87	333.775,14	0,40%	-650.456,26	661.568,97	-852.171,74	856.145,85
EGIE3	520.867,20	41.317,94	30.995,09	0,04%	93.756,10	-93.756,10	76.359,13	-76.984,17
ELET13	2.049.096,19	114,03	91,05	0,00%	-223,36	192,03	496,31	-736,20
ELET24	2.734.866,84	1.716,05	1.411,28	0,00%	-2.545,44	2.068,71	4.546,22	-6.351,95
ELET3	10.578.195,54	964.576,87	502.177,08	0,60%	3.173.458,66	-3.173.458,66	1.550.763,47	-1.563.457,30
ELET42	14.624.531,75	420.995,16	356.961,85	0,43%	-1.136.805,23	-253.737,02	375.808,87	-493.904,44
ELET6	591.966,70	48.832,15	25.635,02	0,03%	177.590,01	-177.590,01	86.782,32	-87.492,68
EMBR3	2.431.679,50	193.694,51	99.896,72	0,12%	607.969,88	-607.969,88	356.513,54	-359.431,79
ENEV3	4.384.950,60	751.533,21	493.548,95	0,59%	1.622.431,80	-2.236.324,91	642.833,79	-648.095,73
ENEV40	210.823,27	8.046,08	7.545,16	0,01%	-25.548,64	-1.561,51	13.107,82	-16.328,14
ENH11	17.508.541,56	2.079.879,63	1.730.426,12	2,07%	2.976.452,07	-3.851.879,14	2.566.752,19	-2.587.762,44
ENH4	13,94	1,31	1,06	0,00%	11,15	-11,15	2,04	-2,06
ENJG21	1.152.973,11	23.889,79	13.852,83	0,02%	-22.617,70	14.723,54	15.774,87	-20.989,41
ENM12	770.795,49	16.069,79	9.326,75	0,01%	-15.264,92	9.820,39	10.604,24	-14.109,04
ENTV12	30.325.935,73	865.842,29	778.604,95	0,93%	-2.439.394,39	-295.936,04	1.003.713,15	-1.302.500,32
EQLT1	13.086,25	13.869,84	9.890,76	0,01%	0,00	0,00	1.918,44	-1.934,15
EQLT3	28.260.861,30	3.912.297,73	3.535.937,55	4,23%	5.652.172,26	-6.652.172,26	4.143.042,27	-4.176.955,30
ERDV17	2.880.107,98	11.475,91	2.117,25	0,00%	-1.373,83	29.944,62	8.947,27	-12.097,51
ERDV17_VENCIMENTO	6.748.495,66	26.889,67	4.961,01	0,01%	-3.219,07	70.164,43	20.964,71	-28.346,17
ERDV38	4.114.374,08	43.129,70	22.277,79	0,03%	-13.373,67	62.814,43	29.314,99	-39.193,04
FRGS11	535.117,50	31.117,69	-6.513,45	-0,01%	267.558,75	-267.558,75	78.448,23	-79.090,37
FLRY3	1.474.399,68	86.820,76	58.274,48	0,07%	294.879,94	-294.879,94	216.146,99	-217.916,27
FMOF11	7.025,85	2.688,37	-1.023,44	0,00%	14.051,70	-7.025,85	1.029,99	-1.038,42
FVPO11	500.517,85	128.368,10	55.950,84	0,07%	250.258,93	-250.258,93	73.375,92	-73.976,54
GARE11	540.755,57	38.737,50	-6.879,60	-0,01%	0,00	0,00	79.274,77	-79.923,67
GASPI7	63.572.219,42	793.212,65	188.178,22	0,23%	-1.414.321,76	1.270.338,84	1.149.995,83	-1.523.786,69
GBSP11	3.472.604,47	145.829,44	104.323,92	0,17%	-518.333,61	-29.955,22	288.296,65	-342.058,61
GGBR4	1.724.083,62	284.923,77	72.493,58	0,09%	-431.020,91	-431.030,92	252.750,66	-254.819,56
GGPS3	6.163.018,58	854.184,22	766.915,02	0,92%	2.773.317,25	-2.773.358,36	903.498,52	-910.894,15
GMAT3	5.472.509,84	724.681,24	462.389,55	0,55%	985.051,77	-875.683,50	802.269,94	-808.836,95
GOAU4	347.022,26	58.443,72	11.793,87	0,01%	104.106,68	-86.755,57	50.873,46	-51.289,89
GRRB14	1.043.454,77	25,57	20,14	0,00%	-45,33	37,34	90,60	-133,20
GRRB24	6.406.491,13	185.132,52	158.979,12	0,19%	-692.442,01	-95.620,35	172.037,24	-225.820,25
GRRB24_VENCIMENTO	16.399.339,81	473.630,69	406.721,58	0,49%	-1.259.830,80	-244.628,73	440.126,60	-577.723,47
GUAR15	1.047.555,10	201,04	161,84	0,00%	-320,42	262,03	616,70	-891,55
GZT11	120.232,00	17.745,79	-5.549,84	-0,01%	60.116,00	-60.116,00	17.626,01	-17.770,29
HAPV22	576.400,57	543,99	454,91	0,00%	-809,48	663,52	1.431,89	-1.970,06
HAPV3	9.171.867,30	2.586.124,36	1.835.807,91	2,20%	3.312.234,88	-3.312.637,44	1.428.157,75	-1.439.847,99
HSRE11	6.522.972,00	352.808,87	-232.836,12	-0,28%	6.522.972,00	-6.522.972,00	956.267,70	-964.095,26
HVRD15	3.554.066,59	126.258,43	117.571,33	0,14%	-377.283,23	-22.523,04	186.757,53	-234.284,08
HYPE3	375.690,56	71.025,59	27.908,50	0,03%	86.408,83	-78.895,02	55.076,24	-55.527,07
HZTC14	2.308.291,27	73.105,81	67.932,17	0,08%	-214.296,24	-7.174,98	108.363,51	-136.196,48
IDU25P432500	9,37	10,68	6,38	0,00%	-9,20	27,16	-9,37	53.565.266,80
IDU25P432600	-18,74	22,10	-13,22	0,00%	18,45	-602,48	18,74	-107.312.820,71
IDU25P432700	9,37	11,45	6,85	0,00%	-9,25	338,20	-9,37	53.747.553,90
IDU25P435100	315,84	3.573,84	2.136,96	0,00%	-315,84	180.271,33	-315,84	20.057.468,69
IDU25P435200	-10.782,40	45.562,42	-27.243,78	-0,03%	16.289,12	-197.301,77	16.289,12	-20.074.218,68
IDN25C447900	2.097.208,08	1.276.053,55	-1.027.519,02	-1,23%	2.798.330,04	-2.037.993,71	67.586.741,96	-2.096.328,21
IDN25C448000	-1.984.253,64	1.276.255,93	1.027.681,97	1,23%	-2.798.946,10	1.944.816,84	-67.585.193,90	1.983.377,03
IDN25P442900	7,78	22,99	18,51	0,00%	-7,78	1.302,65	-7,78	37.328.170,61
IDN25P443000	-7,78	23,30	-18,76	0,00%	7,78	-1.380,15	7,78	-37.400.455,47
IDN25P443100	-7,78	23,62	-19,02	0,00%	7,78	-1.464,20	7,78	-37.472.740,33
IDN25P443200	7,78	23,94	19,28	0,00%	-7,78	1.555,44	-7,78	37.545.025,21
IDN25P445400	7,96	35,50	28,58	0,00%	-7,96	9.461,03	-7,96	40.040.738,74
IDN25P445500	-7,96	36,25	-29,19	0,00%	7,96	-10.541,84	7,96	-40.114.696,24
IDN25P445600	11,94	55,56	44,74	0,00%	-11,94	17.672,97	-11,94	60.282.980,61
IDN25P445700	-31,83	151,41	-121,92	0,00%	31,83	-52.821,50	31,83	-160.999.863,83
IDN25P445800	19,90	96,82	77,96	0,00%	-19,90	37.144,65	-19,90	100.841.421,93
IDN25P448800	4.103,20	29.733,07	23.942,02	0,03%	-4.103,20	2.295.705,24	-4.103,20	98.364.945,73
IDN25P448900	-10.782,40	79.643,84	-64.131,76	-0,08%	10.782,40	-4.939.142,79	10.782,40	-20.074.218,68
IDN25P449000	7.304,80	54.756,09	44.091,35	0,05%	-7.304,80	2.643.004,70	-7.304,80	98.703.659,38
IDN25P449500	79.453,55	597.240,18	480.916,84	0,58%	-79.453,55	8.229.282,78	-79.453,55	246.300.796,07
IDN25P449600	-177.993,06	1.222.408,41	-984.322,23	-1,18%	177.993,06	-8.020.311,26	177.993,06	-220.652.092,61
IDN25P449700	-27.184,95	157.488,41	-126.814,69	-0,15%	27.184,95	-712.609,17	27.184,95	-19.031.288,67
IDN25P449800	-648.647,12	2.997.636,15	-2.413.792,23	-2,89%	648.647,12	-10.304.686,22	648.647,12	-269.781.204,63
IDN25P449900	996.090,48	3.608.190,03	2.905.429,69	3,48%	-996.090,48	10.431.213,28	-996.090,48	269.895.718,87
IDN25P450100	409.605,67	952.764,74	767.196,56	0,92%	-409.605,66	2.348.192,20	-409.605,67	60.163.970,95
IDN25P450200	-1.020.002,64	1.983.092,24	-1.596.849,12	-1,91%	1.020.001,69	-4.706.839,77	1.020.002,64	-120.333.043,25
IDN25P450300	810.646,20	1.355.108,94	1.091.176,93	1,31%	-810.646,25	3.128.429,44	-810.646,20	79.826.375,32
IDN25P450400	-232.708,08	341.667,93	-275.121,91	-0,33%	232.685,93	-771.831,43	232.708,08	-19.658.478,25
IDN25P450500	-265.899,86	348.239,35	-280.413,43	-0,34%	265.797,41	-773.148,36	265.899,86	-19.658.920,57
IDN25P450600	299.189,38	353.765,08	284.863,73	0,34%	-298.854,50	774.387,56	-299.189,38	19.659.265,15
KSNI15	2.937.855,61	74.074,39	68.994,25	0,08%	-225.786,53	-17.537,70	106.752,65	-135.068,47
IGT11	8.388.451,36	927.551,45	813.741,86	0,97%	1.677.690,27	-1.677.690,27	1.229.746,97	-1.239.813,11
IPIL11	32.724,02	960,30	885,08	0,00%	-2.768,53	-1.111,31	1.359,66	-1.717,12
IRBR12	11.331.610,63	237.233,13	139.488,08	0,17%	-188.075,96	185.745,84	161.576,62	-215.258,72

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS		Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Duration DC:	
CNPJ:		10679245000140				Status:		ENQUADRADO		Duration DU:	
PL:	5.034.979.374,07	VAR / PL:	1,6593%								2,085,22
VAR:	83.546.823,49	ETL:	2,0809%								1,429,13
ETL:	104.771.087,24	VAR / CDI:	0,0186%								

Cenários de STRESS											
Cenário Alta - 09999 (+):	147.934.684,32	Cenário Baixa - 10000 (+):	174.989.807,36	CENARIO BRADESCO 1 (+):	330.945.506,02	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.283.603.514,06				
Cenário Alta - 09999 (-):	-175.216.214,25	Cenário Baixa - 10000 (-):	-172.638.790,09	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-74.541.270,12	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-1.554.667.242,14				
Cenário Alta - 09999:	-27.281.529,93	Cenário Baixa - 10000:	2.351.017,27	CENARIO BRADESCO 1:	256.404.235,90	CENARIO BRADESCO 2:	-271.063.728,08				

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
IRBR3	239.795,70	69.825,60	26.840,19	0,03%	155.867,21	-131.888,09	35.154,05	-35.441,80
IRJS14	3.113.291,82	137.812,93	132.020,03	0,16%	-473.576,82	-18.033,48	267.478,90	-319.100,94
ISAE4	522.267,20	40.476,08	34.033,67	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	10.818.656,13	1.272.820,41	1.014.993,05	1,21%	2.055.431,14	-2.055.544,67	1.586.014,99	-1.596.997,38
ITUB4	24.330.418,82	2.974.607,83	2.411.798,54	2,89%	4.866.083,96	-4.622.778,77	3.586.838,55	-3.596.096,05
JAIL15	612.691,18	23.657,40	22.166,89	0,03%	-74.413,17	-3.864,50	38.653,34	-48.097,31
JBS33	4.474.122,80	795.942,64	-206.090,47	-0,25%	1.565.942,98	-1.565.955,60	655.906,40	-661.275,35
JSMLE5	3.207.713,35	93.621,07	89.503,65	0,11%	-324.512,18	-51.154,26	134.777,58	-172.788,41
JSRE11	83.458,22	4.868,97	-2.615,69	0,00%	21.699,14	-21.699,14	12.234,98	-12.335,13
KLBN11	952.869,72	113.272,05	-49.589,60	-0,06%	238.217,43	-190.573,94	139.690,70	-140.834,15
LASC11	5.752.477,00	245.035,20	3.127,97	0,00%	5.752.477,00	-5.752.477,00	843.313,13	-850.216,10
LCAMC3	3.007.234,80	1.014,25	814,05	0,00%	-1.562,29	1.264,14	2.933,74	-4.221,99
LCAMD1	17.618.662,40	522.614,98	501.084,83	0,60%	-1.833.005,52	-295.629,54	760.442,77	-974.280,84
LF001800FAU	4.703.248,59	151.405,04	131.093,92	0,16%	-357.580,59	-40.987,11	142.644,22	-186.882,02
LF002100HDQ	3.154.643,38	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200USM	11.364.164,53	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200USN	11.914.712,40	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	11.815.417,17	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J55	7.039.648,60	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306Z8P	5.847.907,86	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306ZK1	5.866.415,55	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	11.363.784,16	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XG	11.343.468,59	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XN	11.318.663,19	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002C7	6.623.457,86	190.760,32	154.566,61	0,19%	-268.392,10	215.459,53	465.819,46	-650.990,61
LF0024002SX	4.867.046,61	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002TZ	11.304.308,19	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00240033U	7.239.962,05	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024003QF	11.911.293,08	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024005I2	11.957.677,43	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024007F1	7.294.323,74	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024009LF	7.178.416,02	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400D4A	3.610.984,46	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	1.027.021,14	0,00	0,00	0,00%	740,35	-700,77	-1.965,09	2.997,93
LFSC190059S	1.555.635,10	0,00	0,00	0,00%	1.142,97	-1.078,57	-3.013,84	4.598,05
LFSC19005L1	1.029.245,24	0,00	0,00	0,00%	827,71	-770,08	-2.117,41	3.230,90
LFSC22002DX	4.653.125,90	2.700,72	2.170,20	0,00%	-4.063,58	3.294,24	7.513,95	-10.770,32
LFSN1800DC5	5.258.431,85	20.204,16	6.954,97	0,01%	6.111,94	83.368,37	28.341,21	-38.216,93
LFSN210029N	4.969.690,40	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSN2301ERT	4.828.824,56	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	2.268.147,04	67,09	56,01	0,00%	-414,77	435,84	0,15	-0,22
LFT20250901 - 210100	33.591.429,78	8.240,69	6.850,83	0,01%	-44.857,52	53.755,18	-123,66	188,26
LFT20260301 - 210100	13.832.520,63	6.294,98	5.006,60	0,01%	-42.411,08	55.604,83	-3,79	5,77
LFT20260901 - 210100	10.526.055,30	6.925,46	5.389,48	0,01%	-47.844,88	66.259,62	16,97	-25,84
LFT20270301 - 210100	7.437.363,53	6.140,84	4.718,61	0,01%	-38.180,76	68.593,82	1.533,43	-2.333,99
LFT20270901 - 210100	143.575,51	144,67	111,49	0,00%	-884,52	1.704,72	46,12	-70,19
LFT20290301 - 210100	4.580.706,67	5.475,51	4.314,26	0,01%	-35.298,89	96.541,48	4.977,06	-7.567,04
LFT20300301 - 210100	47.634,66	50,58	38,31	0,00%	-601,80	1.286,46	72,50	-110,17
LIGT11	531.629,02	20.633,88	17.292,96	0,02%	-29.492,00	24.134,33	50.516,29	-68.609,38
LMP17	2.632.569,32	264,63	209,51	0,00%	-490,31	414,44	1.045,29	-1.544,93
LORTA7	5.674.580,59	165.761,08	160.291,35	0,19%	-556.212,27	-46.247,25	258.817,20	-331.222,75
LTREN3	1.640.757,30	298.156,63	218.435,01	0,26%	328.151,46	-328.151,46	240.535,02	-242.503,93
LTREN8	702.942,40	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LTN20260701 - 100000	25.210.711,49	524.636,80	417.961,95	0,50%	-719.197,66	577.893,28	1.302.969,17	-1.861.513,16
LWSA3	700.902,72	85.990,80	61.029,64	0,07%	280.361,09	-280.361,09	102.752,34	-103.593,42
MALL11	5.131.753,08	283.971,37	46.968,37	0,06%	1.334.255,80	-1.334.255,80	752.315,00	-758.473,11
MATD3	585.152,84	75.768,46	65.035,12	0,08%	175.545,85	-175.545,85	85.783,41	-86.485,59
MAXR11	588.186,95	57.913,06	-41.509,37	-0,05%	284.093,48	-284.093,48	83.296,21	-83.978,03
MGLU3	146.201,08	43.194,45	37.771,02	0,05%	76.024,56	-65.790,49	21.433,08	-21.608,52
MOVI27	1.175.978,18	1.767,28	1.480,93	0,00%	-2.644,75	2.169,02	4.679,84	-6.424,26
MOVI37	637.282,61	18.664,97	17.855,74	0,02%	-64.865,81	-10.277,19	26.933,70	-34.524,82
MRFG3	1.383.097,38	312.715,32	-97.316,48	-0,12%	553.238,95	-414.929,21	202.762,08	-204.421,79
MRV33	117.983,16	25.459,43	9.183,56	0,01%	35.394,95	-35.397,04	17.296,33	-17.437,91
MTRJ19	5.236.202,98	137.648,36	124.347,08	0,15%	-400.875,87	-45.556,44	168.118,34	-217.373,13
MULT3	6.837.824,00	853.676,86	779.306,51	0,93%	2.051.347,20	-1.709.456,00	1.002.425,00	-1.010.630,39
NEOE16	7.580.091,83	218.384,50	187.483,97	0,22%	-619.638,55	-150.895,56	199.218,57	-261.650,03
NEWL11	5.397.565,80	247.027,06	-59.065,88	-0,07%	2.698.782,90	-2.698.782,90	791.283,15	-797.760,23
NEWU11	1.783.449,98	276.931,26	-145.976,53	-0,17%	1.783.449,98	-1.783.449,98	261.453,77	-263.593,91
NTCO3	4.890.773,00	337.106,38	296.323,24	0,25%	1.022.693,25	-1.022.693,25	593.707,32	-604.616,25
NTEN11	2.887.304,59	68.068,12	58.198,85	0,07%	-171.681,23	-14.226,47	70.111,21	-91.723,84
NTNB20250515 - 760199 - NEGOCIACAO	6.892.235,46	18.991,65	14.816,54	0,02%	-30.055,67	27.281,76	8.141,21	-11.032,82
NTNB20260815 - 760199 - NEGOCIACAO	38.187.366,25	422.967,55	287.378,02	0,34%	-698.278,59	713.082,74	614.720,27	-817.879,55
NTNB20260815 - 760199 - VENCIMENTO	44.239.302,89	489.999,48	332.921,70	0,40%	-808.941,84	826.092,15	712.141,18	-947.947,16
NTNB20270515 - 760199 - NEGOCIACAO	18.874.031,32	340.199,61	253.195,07	0,30%	-442.646,82	450.749,31	435.951,14	-575.159,17
NTNB20280815 - 760199 - NEGOCIACAO	27.602.042,15	607.643,18	512.456,94	0,61%	-915.606,43	922.316,05	965.128,96	-1.253.305,50
NTNB20290515 - 760199 - NEGOCIACAO	1.521.648,19	32.606,73	29.240,12	0,03%	-60.086,95	58.299,58	63.814,38	-82.164,90
NTNB20300815 - 760199 - VENCIMENTO	25.903.159,67	488.723,02	466.398,39	0,56%	-1.158.458,61	1.241.788,28	1.362.968,92	-1.727.635,72
NTNB20350515 - 760199 - VENCIMENTO	218.893.267,61	5.615.950,27	5.097.704,66	6,10%	-15.712.648,71	15.649.807,77	19.216.977,41	-23.142.843,63
NTNB20400815 - 760199 - VENCIMENTO	27.178.102,27	760.023,89	657.115,45	0,79%	-2.811.193,45	2.318.380,50	3.041.497,72	-3.505.212,61
NTNB20450515 - 760199 - VENCIMENTO	199.225.698,15	6.057.599,09	5.085.333,07	6,09%	-21.176.682,52	20.448.104,90	26.421.988,06	-29.295.849,12
NTNB20500815 - 760199 - NEGOCIACAO	851.428,34	29.941,58	27.182,37	0,03%	-97.307,85	93.284,44	122.991,34	-131.983,65
NTNB20500815 - 760199 - VENCIMENTO	633.297.093,13	22.270.920,02	20.218.585,41	24,20%	-72.378.792,52	69.386.132,17	91.482.498,28	-98.111.580,00
NTNB20550515 - 760199 - VENCIMENTO	194.819.312,79	7.715.246,79	7.190.314,16	8,61%	-24.203.787,06	22.288.247,08	30.422.102,22	-31.870.146,93
NTSD36	2.928.901,50	8.048,57	7.284,85	0,01%	-14.134,24	12.202,21	25.311,08	-31.330,59
OMGE13	4.131.025,55	3.256,26	2.712,57	0,00%	-4.866,78	3.981,26	8.656,58	-11.964,98

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Duration DC:		2,085,22	
PL:	5.034.979.374,07	VAR / PL:	1,6593%	Status:		Duration DU:			1,429,13
VAR:	83.546.823,49	ETL / PL:	2,0809%	Benchmark:					
ETL:	104.771.087,24	VAR / CDI:	0,0186%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	147.934.684,32	Cenário Baixa - 10000 (-):	174.989.807,36	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	330.945.506,02	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	1.283.603.514,06
Cenário Alta - 09999 (-):	-175.216.214,25	Cenário Baixa - 10000 (-):	-172.638.790,09	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-74.541.270,12	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-1.554.667.242,14
Cenário Alta - 09999:	-27.281.529,93	Cenário Baixa - 10000:	2.351.017,27	CENÁRIO BRADESCO 1:	256.404.235,90	CENÁRIO BRADESCO 2:	-271.063.728,08

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
OMGE31	13.320.689,67	211.323,42	94.843,64	0,11%	-79.287,56	224.912,41	122.890,08	-164.126,70
OULG11	383.604,57	42.472,42	28.369,34	0,03%	191.802,29	-191.802,29	56.236,43	-56.696,76
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVS410	1.760.382,35	109,11	86,14	0,00%	-196,24	163,42	403,87	-595,28
OVS440	671.503,59	1.074,39	900,39	0,00%	-1.597,55	1.309,98	2.817,23	-3.864,06
PASN12	3.854,59	92,14	78,07	0,00%	-226,23	-13,75	95,18	-124,47
PATC11	3.447.180,00	140.872,19	5.673,08	0,01%	1.723.590,00	-1.723.590,00	505.356,59	-509.493,20
PCAR3	69.257,70	15.273,15	3.548,68	0,00%	25.071,29	-25.071,29	10.153,18	-10.236,29
PETR3	7.233.605,40	430.982,33	195.329,67	0,23%	1.808.401,35	-2.170.081,62	1.060.446,55	-1.069.126,88
PETRA	19.664.908,26	995.337,47	392.222,28	0,47%	4.916.227,07	-5.899.524,65	2.882.875,55	-2.906.473,44
PETZ3	76.381,34	18.227,29	11.352,68	0,01%	29.024,91	-38.954,48	11.197,50	-11.289,16
POMO4	307.793,50	64.087,11	52.641,96	0,06%	76.948,38	-76.948,38	45.122,53	-45.491,88
PQDP11	499.510,00	27.525,79	18.892,67	0,02%	249.755,00	-249.755,00	73.228,17	-73.827,58
PRIO3	17.023.720,86	1.467.831,62	201.619,97	0,24%	9.022.572,06	-5.617.869,42	2.495.677,48	-2.516.105,94
PSSA3	404.698,80	37.494,10	29.957,25	0,04%	64.751,81	-64.751,81	59.328,84	-59.814,48
QAQR11	1.862.261,00	49.334,55	-20.747,26	-0,02%	931.130,50	-931.130,50	273.007,46	-275.242,18
RADL3	2.225.712,06	204.915,24	139.323,96	0,17%	445.142,41	-445.142,41	326.289,39	-328.960,24
RAHD11	8.770.723,70	315.913,34	298.473,60	0,38%	-986.128,73	-986.128,73	546.730,65	-666.774,04
RALL3	13.970.549,60	1.289.808,80	869.235,66	1,04%	6.286.747,32	-4.610.281,37	2.048.082,57	-2.064.847,23
RAZZ4	126.310,10	10.959,98	5.568,38	0,01%	44.208,54	-44.208,54	18.517,06	-18.668,63
RBCAPMZ	452.934,05	6.144,36	314,59	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RBRP11	1.836.937,02	133.694,49	-51.113,27	-0,06%	918.468,51	-918.468,51	269.294,97	-271.499,29
RCRB11	4.774.730,00	555.256,13	-157.651,09	-0,19%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO11	2.486.043,84	413,28	330,14	0,00%	-680,88	560,46	1.353,86	-1.974,73
RDR3	4.117.090,90	573.881,10	413.217,25	0,49%	1.235.127,27	-1.235.142,00	603.565,53	-608.506,04
RDRB9	1.133.087,54	2.220,89	1.938,45	0,00%	-3.505,52	2.944,07	6.162,79	-8.081,90
RDR09	1.620.315,18	3.175,88	2.771,98	0,00%	-5.012,90	4.210,02	8.812,78	-11.557,11
RDVE11	1.957.683,53	61.886,01	57.703,84	0,07%	-180.638,48	1.182,26	97.890,17	-121.415,84
RECV3	426.553,86	33.015,19	7.692,56	0,01%	255.932,32	-255.932,32	62.532,80	-63.044,66
RENT3	13.258.448,91	2.016.327,71	1.513.951,55	1,81%	4.375.288,14	-3.447.196,72	1.943.688,61	-1.959.598,75
RIS412	2.615.347,13	87.391,75	82.943,52	0,10%	-291.694,26	-37.773,72	131.127,36	-165.861,72
RMSA12	7.669.435,08	330.954,67	316.324,01	0,38%	-1.125.777,11	-36.595,41	636.159,49	-761.485,55
RODB11	2.799.344,62	8.525,12	7.331,40	0,01%	-13.094,05	10.899,38	23.051,01	-30.841,83
RSAN24	1.882.948,95	38,47	30,45	0,00%	-82,20	71,35	184,71	-275,18
SANB11	513.281,12	70.247,66	48.069,25	0,06%	102.656,22	-102.656,22	75.247,01	-75.862,95
SARE11	2.431.492,00	158.407,03	30.798,28	0,04%	1.215.746,00	-1.215.746,00	356.456,73	-359.374,52
SBSPP	10.530.653,21	1.057.998,10	911.955,61	1,09%	2.632.663,30	-2.632.663,30	1.543.793,76	-1.556.430,54
SBSPP2	9.259.431,69	18.867,49	-668,50	0,00%	-46.061,49	-34.566,62	-517,87	702,85
SBSPP7	2.340.439,20	1.218,69	986,60	0,00%	-1.845,02	1.492,15	3.386,89	-4.823,24
SCAR3	105.616,00	8.156,60	-392,68	0,00%	63.369,60	-63.369,60	15.483,31	-15.610,05
SLCE3	187.019,28	16.929,91	1.061,18	0,00%	56.105,78	-56.106,86	27.417,03	-27.641,45
SMFT11	17.226,81	67.138,25	-47.763,86	-0,06%	0,00	0,00	0,00	0,00
SMFT3	5.421.294,00	1.006.009,64	689.209,70	0,02%	2.168.513,60	-2.168.513,60	794.780,23	-801.265,78
SMTO11	161.125,14	8.818,23	-89,15	0,00%	48.370,54	-48.370,54	23.637,07	-23.830,55
SNGO18	696.685,56	9,78	7,89	0,00%	-22,85	20,78	57,77	-86,41
SRNA3	517.036,00	135.066,96	95.274,40	0,11%	0,00	0,00	75.797,48	-76.417,92
STBP3	625.325,10	39.930,89	-2.579,22	0,00%	218.863,79	-218.863,79	91.672,66	-92.423,05
SUZB3	11.643.293,97	796.939,22	-144.753,21	-0,17%	2.910.823,49	-2.328.658,79	1.706.906,90	-1.720.878,85
TAE11	406.007,16	16.027,77	10.340,97	0,01%	101.500,58	-101.501,79	59.520,65	-60.007,86
TBSP11	2.138.496,42	964,67	787,48	0,00%	-1.463,98	1.190,67	2.670,93	-3.777,16
TCHI11	3.869.333,45	147.214,93	140.030,69	0,17%	-479.815,63	-15.223,84	262.450,45	-317.825,96
TIMS3	1.682.398,97	224.284,40	165.076,32	0,20%	538.367,67	-386.951,76	246.639,69	-248.658,57
TOTS3	1.411.923,24	260.358,87	214.396,41	0,26%	282.384,65	-282.384,65	206.987,95	-208.682,26
UGPA3	10.303.377,98	1.466.916,54	1.134.253,07	1,36%	2.575.782,20	-2.060.675,60	1.510.475,21	-1.522.839,27
UNEG11	6.993.940,37	296.853,30	279.723,46	0,33%	-900.369,91	36.819,92	541.450,36	-655.780,36
USM5	187.409,68	26.854,25	19.316,36	0,02%	61.389,78	-34.632,98	23.076,86	-23.265,15
VALE3	24.972.749,19	1.586.477,18	967.450,17	1,16%	6.243.187,30	-6.243.187,30	3.661.005,03	-3.690.972,33
VAMO22	733.166,69	51,12	40,20	0,00%	-90,41	74,14	182,14	-267,33
VAMO3	130.200,84	21.432,97	17.836,93	0,02%	45.570,29	-52.080,34	19.087,44	-19.243,68
VAMO33	2.733.006,14	81.543,75	77.795,32	0,09%	-289.420,88	-55.136,37	113.318,63	-145.564,29
VAMO34	790.944,56	23.404,11	22.415,33	0,03%	-81.944,18	-13.215,36	34.022,19	-43.590,12
VBBR3	3.551.660,16	336.028,69	283.433,81	0,34%	887.915,04	-887.915,04	520.673,38	-524.935,37
VECS11	3.441.872,48	3,45	2,78	0,00%	-7,58	6,91	18,47	-27,63
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	3.468.916,34	93.398,53	80.933,94	0,10%	-247.615,82	-34.271,56	95.955,29	-125.354,17
VIMT13	581.165,04	20.317,35	19.139,93	0,02%	-61.589,00	-1.159,96	32.688,01	-40.606,59
VIVA3	149.152,80	30.145,69	25.123,56	0,03%	44.745,84	-44.745,84	21.865,80	-22.044,78
VIVT3	3.918.937,74	369.831,26	273.676,64	0,33%	452.840,66	-452.840,66	442.576,27	-446.199,00
VIX18	2.342.307,85	3.486,44	2.970,70	0,00%	-5.286,46	4.374,92	9.299,94	-12.549,58
VXHO11	23.259,60	1.480,66	-406,43	0,00%	-11.629,80	-11.629,80	3.409,86	-3.437,77
VVMR11	5.707.730,57	485.334,37	-243.180,69	-0,29%	0,00	0,00	836.753,30	-843.602,58
VVRT11	2.278.003,91	469,57	380,09	0,00%	-734,32	598,28	1.379,54	-1.974,93
WDOG25	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOH25	-22.138,41	438.367,03	-270.357,86	-0,32%	526.869,57	-535.870,86	690.259,11	-693.478,14
WEGE3	7.432.216,32	567.031,53	174.258,10	0,21%	1.858.054,08	-1.858.054,08	1.089.562,91	-1.098.481,57
WING25	-10.080,00	111.272,04	97.262,39	0,12%	287.698,08	-287.574,21	232.134,10	-233.805,37
XPIN11	2.681.723,00	222.489,41	49.000,12	0,06%	1.340.861,50	-1.340.861,50	393.140,59	-396.358,66
XPPR11	1.940.167,25	94.869,78	55.552,87	0,07%	970.083,63	-970.083,63	284.428,52	-286.756,72
YDUQ3	1.660.131,00	371.425,96	274.684,36	0,33%	647.451,09	-415.032,75	243.375,21	-245.367,36
Total Var:	2.871.335.770,16	132.488.085,57	83.546.823,49	100,02%	-27.281.529,93	2.351.017,27	256.404.235,90	-271.063.728,08

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/01/2025

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	4.431.180.752,21	VAR / PL:	1,2128%	Limite Fundo:	0,00%	Datation DC:	1.404,50		
VAR:	53.740.048,68	ETL / PL:	1,5209%	Status:	ENQUADRADO	Datation DU:	962,23		
ETL:	67.392.189,11	VAR / CDI:	0,0136%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	138.642.039,85	CENARIO BRADESCO 1 (+):	186.205.193,43	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	-159.612.840,32	Cenário Baixa - 10000 (-):	-216.303,13	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-205.411.831,32		
Cenário Alta - 09999:	-159.612.840,32	Cenário Baixa - 10000:	138.425.736,72	CENARIO BRADESCO 1:	186.205.193,43	CENARIO BRADESCO 2:	-205.411.831,32		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	M/M	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	3.627.610.625,72	48.501.650,87	48.293.878,77	89,87%	-142.983.585,85	133.866.940,89	175.041.101,15	-191.790.452,77	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	106.882.017,67	1.320.485,87	912.111,69	1,70%	-3.150.197,53	351.920,00	1.519.039,40	-1.995.957,23	
FIM EMB II A	250.417.501,51	1.245.013,76	888.700,64	1,65%	-2.044.081,06	2.000.673,07	2.301.881,84	-2.962.224,02	
FIM EMB VI A CRED PRIV	145.211.069,73	3.104.770,26	2.298.140,24	4,28%	-6.593.072,68	2.422.505,89	4.906.885,06	-5.627.171,45	
FIM EMB VII A CRED PRIV	55.190.964,63	1.593.258,62	1.346.217,33	2,51%	-4.841.903,20	-216.303,13	2.436.285,99	-3.036.025,84	
Total Var:	4.183.312.179,25	55.765.179,39	53.740.048,68	100,01%	-159.612.840,32	138.425.736,72	186.205.193,43	-205.411.831,32	

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/01/2025

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	490.181.795,65	VAR / PL:	8,1014%	Limite Fundo:	0,00%	Datation DC:	3,16		
VAR:	39.711.400,69	ETL / PL:	10,1594%	Status:	ENQUADRADO	Datation DU:	1,11		
ETL:	49.799.698,57	VAR / CDI:	0,0907%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	110.581.751,11	Cenário Baixa - 10000 (+):	0,00	CENARIO BRADESCO 1 (+):	62.560.552,43	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-106.058.580,42	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-63.074.269,46		
Cenário Alta - 09999:	110.581.751,11	Cenário Baixa - 10000:	-106.058.580,42	CENARIO BRADESCO 1:	62.560.552,43	CENARIO BRADESCO 2:	-63.074.269,46		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	M/M	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA EMB VIII ETF	86.949.135,96	5.967.804,83	5.905.453,58	14,87%	7.791.731,74	-7.791.731,62	6.345.965,50	-6.397.924,94	
FIA RVA EMB II	93.832.644,85	6.264.148,28	6.185.125,37	15,58%	23.013.358,52	-23.152.933,92	13.348.737,75	-13.458.050,17	
FIA RVA EMB III	101.749.177,56	10.610.678,86	10.457.292,98	26,33%	25.535.530,43	-23.833.647,32	13.530.047,00	-13.642.225,86	
FIA RVA EMB IV	91.453.934,01	9.365.800,07	9.294.274,94	23,38%	25.064.946,61	-21.790.463,33	12.617.396,92	-12.720.999,26	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	116.196.883,26	7.961.940,22	7.879.253,83	19,84%	29.176.183,81	-29.489.804,24	16.718.405,27	-16.855.069,23	
Total Var:	490.181.775,64	40.170.370,26	39.711.400,69	100,00%	110.581.751,11	-106.058.580,42	62.560.552,43	-63.074.269,46	

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RF EMB II									
CNPJ: 11005764000196									
Dados Gerais									
PL:	3.769.684.077,61	VAR / PL:	1,2866%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	1.505,69		
VAR:	-48.501.650,20	ETL / PL:	1,6135%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1.031,60		
ETL:	60.823.026,09	VAR / CDI:	0,0144%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	134.436.535,89	CENARIO BRADESCO 1 (+):	175.041.391,93	CENARIO BRADESCO 2 (+):	397,91		
Cenário Alta - 09999 (-):	-142.983.583,88	Cenário Baixa - 10000 (-):	-569.596,84	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-293,19	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-191.790.848,04		
Cenário Alta - 09999:	-142.983.583,88	Cenário Baixa - 10000:	133.866.939,05	CENARIO BRADESCO 1:	175.041.098,74	CENARIO BRADESCO 2:	-191.790.450,13		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
BBTOPIND	255.639.183,87	5.017.855,82	4.878.512,11	10,06%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	1.893.504.808,00	52.945,77	13.810,81	0,03%	-52.937,62	53.983,58	237.523,45	-361.507,87	0,00
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-135.071,12	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CSMG3	2.771.735,61	10.626,69	4.237,37	0,01%	-2.399,91	34.091,33	11.873,96	-16.032,40	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET42	14.624.531,75	420.995,16	267.163,53	0,55%	-1.136.805,23	-253.737,02	375.808,87	-493.904,44	0,00
ENTV12	13.102.114,45	374.081,28	267.282,42	0,55%	-1.053.923,77	-127.857,16	433.647,45	-562.736,41	0,00
GASPI7	52.674.124,66	657.233,34	55.558,53	0,11%	-1.171.866,60	1.052.566,47	952.853,68	-1.262.566,11	0,00
IGSN15	2.397.855,61	74.074,39	58.527,80	0,12%	-225.786,53	-17.537,70	106.752,65	-135.068,47	0,00
LFT20301201 - 210100	36.648.168,67	32.809,29	21.657,00	0,04%	-643.643,90	1.137.341,68	63.599,82	-96.617,15	0,00
NEOE16	7.580.091,83	218.384,50	141.708,51	0,29%	-619.638,55	-150.895,56	199.218,57	-261.650,03	0,00
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	44.239.302,89	489.999,48	245.510,57	0,51%	-808.941,84	826.092,15	712.141,18	-947.497,16	0,00
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	25.903.159,67	488.723,02	439.376,80	0,91%	-1.158.458,61	1.241.788,28	1.362.908,62	-1.727.635,72	0,00
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	218.893.267,61	5.615.950,27	5.516.436,16	11,37%	-15.712.648,71	15.649.807,77	19.216.977,41	-23.142.843,63	0,00
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	27.178.102,27	760.023,89	748.356,63	1,54%	-2.611.193,45	2.318.380,50	3.041.497,72	-3.505.212,61	0,00
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	199.225.698,15	6.057.599,09	5.917.151,02	12,20%	-21.176.682,52	20.448.104,90	26.421.988,06	-29.295.849,12	0,00
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	633.297.093,13	22.270.920,02	22.222.403,41	45,82%	-72.378.792,52	69.386.132,17	91.482.498,28	-98.111.580,00	0,00
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	194.819.312,79	7.715.246,79	7.702.047,85	15,88%	-24.203.787,06	22.288.247,08	30.422.102,22	-31.870.146,93	0,00
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SBSPC2	5.242.095,95	10.681,56	1.909,69	0,00%	-26.077,06	-19.569,40	-293,19	397,91	0,00
Total Var:	3.627.610.575,80	50.268.150,36	48.501.650,20	99,99%	-142.983.583,88	133.866.939,05	175.041.098,74	-191.790.450,13	

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO									
CNPJ: 20726178000121									
Dados Gerais									
PL:	106.885.042,71	VAR / PL:	1,2354%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	569,86		
VAR:	1.320.485,87	ETL / PL:	1,5493%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	389,55		
ETL:	1.655.942,56	VAR / CDI:	0,0138%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	6.111,94	Cenário Baixa - 10000 (+):	782.475,37	CENARIO BRADESCO 1 (+):	1.519.306,79	CENARIO BRADESCO 2 (+):	362,90		
Cenário Alta - 09999 (-):	-3.156.309,47	Cenário Baixa - 10000 (-):	-430.555,38	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-267,39	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-1.996.320,14		
Cenário Alta - 09999:	-3.150.197,53	Cenário Baixa - 10000:	351.920,00	CENARIO BRADESCO 1:	1.519.039,40	CENARIO BRADESCO 2:	-1.995.957,23		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
17H0164854	5.736.331,75	113.796,68	104.039,07	7,88%	-117.243,68	66.570,54	78.301,57	-104.075,18	0,00
AEGP23	7.696.223,03	29.506,91	5.317,23	0,40%	-6.663,79	94.660,71	32.970,18	-44.516,83	0,00
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	763.579,46	1.555,91	-404,37	-0,03%	-3.798,46	-2.850,54	-42,71	57,96	0,00
COMPROMISSADA_PRE	16.928.175,94	473,34	224,62	0,02%	-473,27	482,62	2.123,49	-3.231,93	0,00
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-23.869,91	0,00	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	0,00
ENJG21	1.152.973,11	23.889,79	21.395,85	1,62%	-22.617,70	14.723,54	15.774,87	-20.989,41	0,00
ENM21	770.795,49	16.069,79	14.401,11	1,89%	-15.264,92	9.820,39	10.604,24	-14.109,04	0,00
ENTV12	17.223.821,28	491.761,01	482.041,50	36,50%	-1.385.470,62	-168.078,89	570.065,71	-739.763,91	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	6.748.495,66	26.889,67	898,69	0,07%	-3.219,07	70.164,43	20.964,71	-28.346,17	0,00
GASPI7	10.898.094,76	135.979,31	61.109,73	4,63%	-242.455,16	217.772,37	197.142,14	-261.220,58	0,00
GRRB24_VENCIMENTO	16.389.939,81	473.630,69	464.561,79	35,18%	-1.259.830,80	-244.628,73	440.128,60	-577.723,47	0,00
LFSN1800DC5	5.258.431,85	20.204,16	5.539,26	0,42%	6.111,94	83.368,37	28.341,21	-38.216,93	0,00
OMGE31	13.320.689,67	211.323,42	163.488,84	12,38%	-79.287,56	224.912,41	122.890,08	-164.126,70	0,00
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SBSPC2	4.017.335,74	8.185,93	-2.127,46	-0,16%	-19.984,43	-14.997,22	-224,69	304,94	0,00
Total Var:	106.882.017,65	1.553.266,60	1.320.485,87	100,00%	-3.150.197,53	351.920,00	1.519.039,40	-1.995.957,23	

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		928,06	
PL:	292.992.083,06	VAR / PL:	2,2763%	Status:		Dutation DC:			635,69
ETL:	4.353.070,26	ETL / PL:	2,8546%	Benchmark:		Dutation DU:			
	5.509.087,34	VAR / CDI:	0,0255%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	820.861,32	Cenário Baixa - 10000 (+):	4.643.278,78	CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.047.469,83	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.050.489,74
Cenário Alta - 09999 (-):	-10.149.677,64	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.215.573,13	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-1.104.511,40	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-9.012.611,72
Cenário Alta - 09999:	-9.328.816,32	Cenário Baixa - 10000:	3.427.705,65	CENARIO BRADESCO 1:	6.942.958,42	CENARIO BRADESCO 2:	-7.962.121,98

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
020913	377.391,59	20.430,32	12.149,85	0,28%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEGP1	1.914.513,44	2.415,33	2.362,23	0,05%	-3.612,20	2.960,13	6.388,37	-8.776,23
APRB28	895.297,95	85,06	83,03	0,00%	-133,08	108,19	252,53	-364,24
ARTR1	2.629.384,16	271,65	264,84	0,01%	-438,77	357,82	851,33	-1.234,89
BARU11	1.474.557,77	70.075,50	60.265,18	1,37%	-248.329,76	-15.082,49	136.717,91	-163.425,17
BCBF15	1.011.795,36	10,12	8,25	0,00%	-32,14	8,25	100,69	-151,75
BRKPA0	2.860.177,72	1.235,61	1.206,20	0,03%	-1.903,26	1.540,04	3.574,03	-5.143,44
CAEC11	1.937.012,88	32,59	31,09	0,00%	-71,24	62,31	171,24	-255,27
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	923.319,19	29.685,18	26.928,28	0,61%	-90.483,37	-6.075,36	43.861,90	-55.239,78
CBAN22	4.536.185,08	88.214,18	85.526,36	1,95%	-121.358,85	99.236,62	199.165,19	-262.757,97
CEAB13	1.493.868,78	658,13	642,52	0,01%	-990,51	798,15	1.809,77	-2.584,68
CGBP13	2.424.726,07	1.881,84	1.841,06	0,04%	-2.832,39	2.325,89	5.047,85	-6.950,96
CLN12	2.478.024,97	6.744,65	6.586,05	0,15%	-10.679,49	8.961,78	18.873,36	-24.854,53
COMPROMISSADA PRE	2.896.811,77	78,48	34,27	0,00%	-78,47	80,02	352,09	-535,88
CONTAS A PAGAR RECEBER	-78.196,03	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRTR12	2.782.044,00	114.367,53	98.708,41	2,25%	-379.946,46	-11.204,04	212.325,89	-256.003,09
CSAN23	1.142.282,35	2.338,18	2.281,41	0,05%	-3.687,47	3.096,26	6.480,51	-8.500,72
CSMG88	2.733.056,61	75.485,12	70.864,25	1,61%	-197.918,25	-24.055,61	79.040,82	-103.098,72
DAPK25	-4.915,03	33.225,87	-9.206,04	-0,21%	-63.290,99	60.178,79	19.816,28	-19.908,89
DAPK27	-15.835,78	665.052,41	642.941,23	14,64%	-907.193,56	832.567,02	975.434,85	-955.770,28
DAPK29	-4.916,16	176.644,08	173.728,68	3,95%	-309.497,45	281.687,51	368.597,20	-351.875,36
DAPK35	8.416,78	39.321,78	-23.003,31	-0,52%	107.039,34	-100.204,04	-148.122,84	130.594,65
DAPQ26	9.915,81	340.018,62	315.910,47	7,19%	-539.466,43	508.024,67	524.702,53	-158.639,08
DAPQ28	-30.594,99	1.279.850,77	1.268.967,68	28,89%	-1.908.995,06	1.732.903,21	2.200.833,41	-2.120.790,02
DAPQ30	12.973,69	130.631,78	-118.749,51	-2,70%	305.148,08	-276.807,98	-380.664,75	357.285,68
DAPQ32	14.605,18	127.288,68	-97.292,13	-2,21%	337.929,87	-307.581,84	-445.885,04	407.279,19
DASACS	1.969.843,91	5.439,65	5.289,66	0,12%	-8.994,06	7.655,68	15.919,11	-20.366,77
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIF27	-1.434,97	78.653,31	76.736,71	1,75%	-108.738,22	87.292,96	188.725,52	-263.747,11
DIF31	-3.100,14	35.596,06	-33.660,77	-0,77%	68.033,01	-60.132,90	-122.660,53	144.378,65
ELI224	2.734.866,84	1.716,05	1.677,63	0,04%	-2.545,44	2.068,71	4.546,22	-6.351,95
GUAR15	1.047.555,10	201,04	196,28	0,00%	-320,42	262,03	616,70	-891,55
HAPV22	576.400,57	543,99	531,99	0,01%	-809,48	663,52	1.431,89	-1.970,06
HZTC14	2.308.291,27	73.105,81	65.875,60	1,50%	-214.296,24	-7.174,98	108.363,51	-136.196,48
IRJS14	3.113.291,82	137.812,93	118.674,10	2,70%	-473.576,82	-18.033,48	267.478,90	-319.100,94
JSMILB5	3.207.713,35	93.621,07	87.700,43	2,00%	-324.512,18	-51.154,26	134.777,58	-172.788,41
LCAMD1	7.352.808,31	218.103,26	203.973,73	4,64%	-764.969,44	-123.375,28	317.356,09	-406.597,28
LF001800FAU	4.703.248,59	151.405,04	148.727,12	3,39%	-357.580,59	-40.987,11	142.644,22	-186.882,02
LF002306ZBP	5.847.907,86	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306ZK1	5.866.415,55	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	1.027.021,14	0,00	0,00	0,00%	740,35	-700,77	-1.965,09	2.997,93
LFSC190059S	1.555.635,10	0,00	0,00	0,00%	1.142,97	-1.078,57	-3.013,84	4.598,05
LFSC190051L	1.029.245,24	0,00	0,00	0,00%	827,71	-770,08	-2.117,41	3.230,90
LFSC2002IX	4.653.125,90	2.700,72	2.636,40	0,06%	-4.063,58	3.294,24	7.513,95	-10.770,32
LFNS210029N	4.969.690,40	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFNS2031ERT	4.828.824,56	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250901 - 210100	22.250.520,62	5.459,53	4.515,54	0,10%	-29.713,04	35.806,74	-81,91	124,70
LIGHB4	1.261.717,29	39.544,36	37.330,24	0,85%	-130.578,73	-28.343,97	54.587,81	-69.019,88
LIGHC3	473.056,17	14.826,38	13.996,24	0,32%	-52.332,31	-10.627,02	20.466,63	-26.215,09
LIGHC4	111.687,38	18.627,62	15.783,18	0,36%	-55.806,52	2.400,51	33.489,66	-40.766,46
LIGHD3	152.871,81	7.067,51	5.998,43	0,14%	-22.201,80	412,30	13.099,87	-15.840,00
LIGT11	1.063.258,05	41.267,77	40.241,38	0,92%	-58.984,01	48.268,65	101.032,58	-137.218,76
LMP17	2.632.569,32	264,63	256,25	0,01%	-490,31	414,44	1.045,29	-1.544,93
LRENB1	702.942,40	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
MOVIZ7	1.175.978,18	1.767,28	1.728,51	0,04%	-2.644,75	2.169,02	4.679,84	-6.424,26
MTRJ19	2.531.531,00	66.548,43	62.266,52	1,42%	-193.810,23	-22.025,03	81.279,66	-105.092,72
NTEN11	2.887.304,59	68.068,12	63.275,09	1,44%	-171.681,23	-14.226,47	70.111,21	-91.723,84
NTNB20250515 - 760199 - NEGOCIACAO	629.427,90	1.734,40	1.534,45	0,03%	-2.744,81	2.491,49	743,49	-1.007,56
NTNB20260815 - 760199 - NEGOCIACAO	21.911.726,72	242.696,74	227.784,41	5,19%	-400.668,89	409.163,44	352.723,53	-469.295,35
NTNB20270515 - 760199 - NEGOCIACAO	5.048.109,48	90.990,89	88.489,24	2,01%	-118.391,75	120.558,87	116.600,90	-153.833,93
NTNB20280815 - 760199 - NEGOCIACAO	8.230.065,79	181.180,19	179.476,08	4,09%	-273.005,20	275.005,80	287.771,27	-373.696,51
NTNB20500815 - 760199 - NEGOCIACAO	418.108,20	14.703,45	9.289,18	0,21%	-47.785,10	45.809,32	60.397,53	-64.774,11
NTSD36	2.928.901,50	8.048,57	7.786,50	0,18%	-14.134,24	12.202,21	25.311,08	-31.330,59
OMGE13	3.194.598,01	2.518,12	2.462,99	0,06%	-3.763,57	3.076,78	6.894,30	-9.252,74
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVS410	1.760.382,35	109,11	105,82	0,00%	-196,24	163,42	403,87	-595,28
OVS4A8	671.503,59	1.074,39	1.050,59	0,02%	-1.597,55	1.309,98	2.817,23	-3.864,86
RAHD11	3.201.495,13	115.314,89	101.291,04	2,31%	-359.957,33	-3.021,77	199.567,97	-243.386,28
RBCAPMZ	452.934,05	6.144,36	378,94	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	2.486.043,84	413,28	402,84	0,01%	-680,88	560,46	1.353,86	-1.974,73
RDORB9	1.133.087,54	2.220,89	2.166,91	0,05%	-3.505,52	2.944,07	6.162,79	-8.081,90
RDORC9	1.620.315,18	3.175,88	3.098,68	0,07%	-5.012,90	4.210,02	8.812,78	-11.557,11
RIS412	2.615.347,13	87.391,75	79.388,95	1,81%	-291.694,26	-37.773,72	131.127,36	-165.861,72
RODB11	2.799.344,62	8.525,12	8.330,94	0,19%	-13.094,05	10.899,38	23.051,01	-30.841,83
RSAN24	1.882.948,95	38,47	36,82	0,00%	-82,20	71,35	184,71	-275,18
SNGO18	696.685,56	9,78	9,26	0,00%	-22,85	20,78	57,77	-86,41
TBSP11	2.138.496,42	964,67	943,36	0,02%	-1.463,98	1.190,67	2.670,93	-3.777,16
UNEG11	4.177.850,13	177.326,16	151.009,17	3,44%	-537.838,52	23.188,59	323.436,91	-391.732,26
VAMO33	2.733.006,14	81.543,75	77.332,52	1,76%	-289.420,88	-55.136,37	113.318,63	-145.564,29
VECS11	3.441.872,48	3,45	3,28	0,00%	-7,58	6,91	18,47	-27,63
VERDEC32	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WXL18	2.342.307,85	3.486,44	3.408,63	0,08%	-5.286,46	4.374,92	9.299,94	-12.549,58
VVRT11	2.278.003,91	469,57	458,95	0,01%	-734,32	598,28	1.379,54	-1.974,93
Total Var:	205.465.260,88	5.298.469,18	4.393.070,26	100,03%	-9.328.816,32	3.427.705,65	6.942.958,42	-7.962.121,98

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/01/2025

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		1.661,96	
PL:	125.616.879,03	VAR / PL:	3,2336%	Status:		Dutation DU:			1.138,53
VAR:	4.062.008,29	ETL / PL:	4,0531%	Benchmark:					
ETL:	5.093.922,27	VAR / CDI:	0,0362%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	365.591,26	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.211.304,13	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-12.344.418,32	Cenário Baixa - 10000 (-):	-917.055,47	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-7.740.339,17
Cenário Alta - 09999:	-12.344.418,32	Cenário Baixa - 10000:	-551.464,20	CENARIO BRADESCO 1:	6.211.304,13	CENARIO BRADESCO 2:	-7.740.339,17

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

Produto	MHM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
APPSA2	2.866.516,84	83.429,61	82.027,48	2,02%	-279.780,62	-45.232,75	113.645,72	-146.180,00
ASAB11	2.578.297,48	74.856,08	74.462,52	1,83%	-246.104,27	-42.737,74	99.474,87	-127.226,74
ASER12	4.470.428,96	198.988,88	194.307,95	4,78%	-690.112,96	-24.712,48	393.877,47	-468.021,34
ATHT11	654,68	23,67	23,51	0,00%	-75,43	-1,61	41,41	-50,41
BRKP28	4.995.745,60	187.308,51	185.155,17	4,56%	-648.399,37	-92.559,79	298.149,91	-373.219,34
CAEC21	4.195.490,46	119.542,10	111.020,34	2,73%	-250.172,36	-20.485,68	100.337,87	-132.083,07
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	5.204.162,73	167.316,49	167.223,07	4,12%	-509.997,18	-34.242,95	247.221,61	-311.351,49
CDSES11	2.686.132,41	111.679,94	110.105,46	2,71%	-338.283,99	13.085,65	201.417,78	-244.462,69
CJEN13	3.935.525,32	126.175,84	126.108,84	3,10%	-368.680,71	-11.474,85	187.412,88	-235.226,17
CNRD11	5.900.143,85	209.984,38	209.392,01	5,15%	-608.030,00	-5.042,30	325.615,58	-405.712,51
COMPROMISSADA PRE	5.349.225,05	149,57	59,54	0,00%	-149,55	152,51	671,01	-1.021,27
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-79.019,32	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	2.797.358,36	68.562,12	67.413,01	1,66%	-183.956,29	-6.407,58	84.040,87	-108.853,45
CSMG89	3.184.048,42	101.622,47	101.235,15	2,49%	-323.535,15	-38.404,57	144.628,91	-183.555,09
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENAT24	2.450.244,10	93.118,11	92.160,24	2,27%	-293.646,18	-17.754,95	150.402,85	-187.304,97
ENEVA0	210.823,27	8.046,08	7.951,32	0,20%	-25.548,64	-1.561,51	13.107,82	-16.328,14
ERDV17	2.880.107,98	11.475,91	1.513,26	0,04%	-1.373,83	29.944,62	8.947,27	-12.097,51
ERDV38	4.114.374,08	43.129,70	31.549,95	0,78%	-13.373,67	62.814,43	29.314,99	-39.193,04
GBSP11	3.472.604,47	145.829,44	142.595,77	3,51%	-518.333,61	-29.955,22	288.296,65	-342.058,61
GRRB24	6.406.491,13	185.132,52	175.843,23	4,32%	-492.442,01	-95.620,35	172.037,24	-225.820,25
HGLB23	3.715.918,81	129.489,93	129.254,29	3,18%	-403.742,22	-29.306,79	197.541,72	-248.427,15
HVRD15	5.378.209,42	191.061,21	190.954,85	4,70%	-570.925,77	-34.083,10	282.611,79	-354.531,58
IPIL11	32.724,02	960,30	959,26	0,02%	-2.768,53	-111,31	1.359,66	-1.717,12
IRBR12	11.331.610,63	237.233,13	189.760,79	4,67%	-188.075,96	185.745,84	161.576,62	-215.258,72
JALL15	612.691,18	23.657,40	23.370,88	0,58%	-74.413,17	-3.864,50	38.653,34	-48.097,31
LCAMD1	10.265.854,09	304.511,72	301.285,38	7,42%	-1.068.036,08	-172.254,26	443.086,67	-567.683,56
LORTA7	5.674.580,59	165.761,08	163.597,29	4,03%	-556.212,27	-46.247,25	258.817,20	-331.222,75
MOVI37	637.282,61	18.664,97	18.482,91	0,46%	-64.865,81	-10.277,19	26.933,70	-34.524,82
MTRJ19	2.704.671,98	71.099,93	70.207,40	1,73%	-207.065,64	-23.531,41	86.838,68	-112.280,41
OMGE31	3.355.305,79	53.229,58	35.881,89	0,88%	-19.971,49	56.652,47	30.954,39	-41.341,35
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	3.854,59	92,14	88,64	0,00%	-226,23	-13,75	95,18	-124,47
RAHD11	5.569.228,57	200.598,45	199.457,85	4,91%	-626.171,39	-5.256,58	347.162,68	-423.387,75
RDVE11	2.592.175,05	81.943,47	81.835,25	2,01%	-239.184,00	1.565,43	129.616,69	-160.767,11
RMSA12	7.669.435,08	330.954,67	324.351,99	7,99%	-1.123.777,11	-36.595,41	636.159,49	-761.485,55
RRRP13	1.193,73	37,68	37,50	0,00%	-125,21	-17,40	54,62	-69,41
TCR11	3.869.333,45	147.214,93	146.127,67	3,60%	-479.815,63	-15.223,84	262.450,45	-317.825,96
UNEG11	2.816.090,24	119.527,14	117.654,39	2,90%	-362.531,39	15.630,33	218.013,45	-264.048,10
VAMO34	790.944,56	23.404,11	23.195,88	0,57%	-81.944,18	-13.215,36	34.022,19	-43.590,12
VBR11	2.017.664,27	56.856,83	55.403,33	1,36%	-171.365,61	-25.431,50	86.069,60	-88.229,08
VERO12	3.468.916,34	93.398,53	89.920,27	2,21%	-247.615,82	-34.271,56	95.955,29	-125.354,17
VIMT13	581.165,04	20.317,35	20.232,77	0,50%	-61.589,00	-1.159,96	32.688,01	-40.606,59
Total Var:	140.709.205,92	4.206.384,97	4.062.008,29	99,99%	-12.344.418,31	-551.464,21	6.211.304,13	-7.740.339,17

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		
PL: 236.002.669,80	VAR / PL: 0,4982%	Limite Fundo: 512,38
VAR: 1.175.762,98	ETL / PL: 0,6248%	Status: ENQUADRADO
ETL: 1.474.453,71	VAR / CDI: 0,0056%	Benchmark: 350,89
		0,00% Dutation DC: 0,00%
		Dutation DU: 0,00%

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	443.322,82	Cenário Baixa - 10000 (+):	2.256.298,25	CENARIO BRADESCO 1 (+):	2.941.338,84	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.025.425,84
Cenário Alta - 09999 (-):	-2.373.706,33	Cenário Baixa - 10000 (-):	-366.908,26	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-767.494,17	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-3.822.882,61
Cenário Alta - 09999:	-1.930.383,51	Cenário Baixa - 10000:	1.889.390,00	CENARIO BRADESCO 1:	2.173.844,68	CENARIO BRADESCO 2:	-2.797.456,77

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CDB323R5TI	7.113.823,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	16.830.100,59	470,60	200,93	0,02%	-470,53	479,82	2.111,19	-3.213,20
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-40.677,32	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
DHF27	2.705,94	148.317,67	-144.768,89	-12,31%	205.049,21	-164.609,58	-355.882,40	497.351,70
DHF28	2.838,67	214.771,43	208.652,61	17,75%	-305.043,78	252.060,77	520.114,52	-696.248,92
DHF29	-5.969,39	154.624,32	-148.776,51	-12,65%	238.273,61	-202.298,67	-411.611,68	528.074,02
DHF31	8.008,69	91.961,66	85.686,77	7,29%	-175.751,95	155.343,33	316.873,05	-372.978,18
LF002200U5M	11.364.164,53	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200U5N	11.914.712,40	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	11.815.417,17	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	7.099.648,60	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	11.363.784,16	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XG	11.343.468,59	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XN	11.318.663,19	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002C7	6.623.457,86	190.760,32	186.159,75	15,83%	-268.392,10	215.459,53	465.819,46	-650.990,61
LF0024002SX	4.867.046,61	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002TZ	11.304.308,19	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00240033U	7.239.962,05	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024003CF	11.911.293,08	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024006I2	11.957.677,43	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024007F1	7.294.323,74	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024009LF	7.178.416,02	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400D4A	3.610.984,46	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	670.860,39	19,84	14,98	0,00%	-122,68	128,91	0,04	-0,07
LFT20260301 - 210100	287.511,98	130,84	101,42	0,01%	-881,52	1.155,74	-0,08	0,12
LFT20260901 - 210100	990.311,73	651,56	476,22	0,04%	-4.501,34	6.233,83	1,60	-2,43
LFT20270301 - 210100	430.920,20	355,80	245,88	0,02%	-2.212,19	3.974,32	88,85	-135,23
LFT20270901 - 210100	143.575,51	144,67	97,32	0,01%	-884,52	1.704,72	46,12	-70,19
LFT20300301 - 210100	47.634,66	50,58	38,30	0,00%	-601,80	1.286,46	72,50	-110,17
NTNB20250515 - 760199 - NEGOCIACAO	6.262.807,56	17.257,25	14.983,95	1,27%	-27.310,86	24.790,27	7.397,72	-10.025,25
NTNB20260815 - 760199 - NEGOCIACAO	16.275.639,53	180.270,81	173.732,64	14,78%	-297.609,70	303.919,30	261.996,74	-348.584,21
NTNB20270515 - 760199 - NEGOCIACAO	14.172.870,94	255.462,39	252.656,67	21,49%	-332.391,96	338.476,27	327.364,04	-431.896,02
NTNB20280815 - 760199 - NEGOCIACAO	19.371.976,37	426.462,99	425.762,96	36,21%	-642.601,23	647.310,25	677.357,69	-879.608,00
NTNB20290515 - 760199 - NEGOCIACAO	4.509.996,16	96.642,73	95.019,04	8,08%	-178.091,03	172.793,49	189.138,74	-243.527,62
NTNB20500815 - 760199 - NEGOCIACAO	1.197.309,86	42.105,34	25.478,55	2,17%	-136.839,16	131.181,24	172.956,58	-185.489,50
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
Total Var:	236.488.573,87	1.820.460,81	1.175.762,58	100,01%	-1.930.383,51	1.889.390,00	2.173.844,68	-2.797.456,77

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB I A
CNPJ: 20725946000122

Dados Gerais		Limites		ENQUADRADO		0,00%		Dutacion DC:		438,00	
PL:	135.940.012,69	VAR / PL:	0,1036%	Status:				Dutacion DC:			438,00
VAR:	140.783,58	ETL / PL:	0,1299%	Benchmark:				Dutacion DU:			299,42
ETL:	176.548,29	VAR / CDI:	0,0012%								

Cenários de STRESS											
Cenário Alta - 09999 (+):	6.574.022,75	Cenário Baixa - 10000 (+):	33.900.051,29	CENARIO BRADESCO 1 (+):	73.963.411,18	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.281.541.019,56				
Cenário Alta - 09999 (-):	-7.366.196,82	Cenário Baixa - 10000 (-):	-33.668.298,95	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-72.489.286,28	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-1.277.270.353,59				
Cenário Alta - 09999:	-792.174,07	Cenário Baixa - 10000:	231.752,34	CENARIO BRADESCO 1:	1.474.124,90	CENARIO BRADESCO 2:	4.270.665,97				

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
BCBF14	88.796,59	0,36	0,04	0,00%	-1,22	1,24	4,67	-7,07
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	3.027.138,47	58.868,06	-26.221,39	-18,63%	-80.986,56	66.223,71	132.909,17	-175.346,63
CEBEA3	1.897.089,17	239,18	-126,11	-0,09%	-398,40	325,43	786,56	-1.148,49
CGBP13	1.911.071,55	1.483,03	-706,04	-0,50%	-2.232,38	1.833,17	3.978,51	-5.478,47
COMPROMISSADA PRE	29.253.259,67	817,97	-298,41	-0,21%	-817,85	834,01	3.669,56	-5.585,03
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-14.700,93	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPT12	1.677.584,41	1.891,60	-839,75	-0,60%	-2.946,83	2.456,78	5.198,11	-6.925,38
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF26	6.919,54	199.227,04	106.676,71	75,77%	321.364,95	-256.391,96	-603.716,48	882.024,06
DHF27	-4.140,91	226.970,98	-114.115,54	-81,06%	-315.787,42	251.902,55	544.607,92	-761.098,81
DHF31	-7.233,65	83.062,15	24.661,96	17,52%	158.743,69	-140.310,10	-286.207,91	336.983,52
DHG25	49,68	4.220,16	1.539,57	1,09%	4.219,51	-4.302,88	-18.932,33	28.814,78
DHH25	14,54	3.487,63	-592,69	-0,42%	6.979,18	-7.103,58	-1.346,68	47.558,48
DHJ25	99,88	168.319,00	-5.919,85	-4,20%	-411.678,81	418.369,23	1.528.837,92	-2.312.337,38
DHN26	19.423,57	537.873,12	273.740,86	198,70%	754.858,65	-597.202,00	-1.357.061,70	1.938.916,66
ELET13	2.049.096,19	114,03	-58,78	-0,04%	-223,36	192,03	496,31	-736,20
GRRB14	1.043.454,77	25,57	-13,73	-0,01%	-45,33	37,34	90,60	-133,20
IDJ25P432500	9,37	10,68	0,99	0,00%	-9,20	270,16	-9,37	53.565.266,80
IDJ25P432600	-18,74	22,10	-2,05	0,00%	18,45	-602,48	18,74	-107.312.820,71
IDJ25P432700	9,37	11,45	1,06	0,00%	-9,25	338,20	-9,37	53.747.553,90
IDJ25P435100	315,84	3.573,84	332,11	0,24%	-315,84	180.271,33	-315,84	20.057.488,69
IDJ25P435200	-16.269,12	45.562,42	-4.234,06	-3,01%	16.269,12	-197.301,77	16.269,12	-20.074.218,68
IDN25C447900	2.097.208,08	1.276.053,55	626.480,71	445,00%	2.796.330,04	-2.037.993,71	67.586.741,96	-2.096.328,21
IDN25C448000	-1.984.253,64	1.276.255,93	-626.580,07	-445,00%	-2.796.346,10	1.944.816,84	-67.585.193,90	1.985.377,03
IDN25P442900	7,78	22,99	-11,29	-0,01%	-7,78	1.302,65	-7,78	37.328.170,61
IDN25P443000	-7,78	23,30	11,44	0,01%	7,78	-1.380,15	7,78	-37.400.455,47
IDN25P443100	-7,78	23,62	11,59	0,01%	7,78	-1.464,20	7,78	-37.472.740,33
IDN25P443200	7,78	23,94	-11,76	-0,01%	-7,78	1.555,44	-7,78	37.545.025,21
IDN25P445400	7,96	35,50	-17,43	-0,01%	-7,96	9.461,03	-7,96	40.040.738,74
IDN25P445500	-7,96	36,25	17,80	0,01%	7,96	-10.541,84	7,96	-40.114.696,24
IDN25P445600	11,94	55,56	-27,28	-0,02%	-11,94	17.672,97	-11,94	60.282.980,61
IDN25P445700	-31,83	151,41	74,33	0,05%	31,83	-52.821,50	31,83	-160.999.863,83
IDN25P445800	19,90	96,82	-47,53	-0,03%	-19,90	37.144,65	-19,90	100.841.421,93
IDN25P448800	4.103,20	29.733,07	-14.597,50	-10,37%	-4.103,20	2.295.705,24	-4.103,20	98.364.945,73
IDN25P448900	-10.782,40	79.643,84	39.101,28	27,77%	10.782,40	-4.933.142,79	10.782,40	-197.069.230,70
IDN25P449000	7.304,80	54.756,09	-26.882,60	-19,09%	-7.304,80	2.643.004,70	-7.304,80	98.703.659,38
IDN25P449500	79.453,55	597.240,18	-293.216,10	-208,27%	-79.453,55	8.229.282,78	-79.453,55	246.300.796,07
IDN25P449600	-177.993,06	1.222.408,41	600.143,53	426,29%	177.993,06	-8.020.311,26	177.993,06	-220.652.092,61
IDN25P449700	-27.184,95	157.488,41	77.319,21	54,92%	27.184,95	-712.609,17	27.184,95	-19.031.288,67
IDN25P449800	-648.647,12	2.897.636,15	1.471.694,69	1,045,36%	648.647,12	-10.304.686,22	648.647,12	-269.781.204,63
IDN25P449900	996.090,48	3.008.190,03	-1.771.447,18	-1,258,28%	-996.090,48	10.431.213,28	-996.090,48	269.895.718,87
IDN25P450100	409.605,67	952.764,74	-467.761,51	-332,26%	-409.605,66	2.348.192,20	-409.605,67	60.163.970,95
IDN25P450200	-1.020.002,64	1.983.092,24	973.602,59	691,56%	1.020.001,69	-4.706.839,77	1.020.002,64	-120.333.043,25
IDN25P450300	810.646,20	1.355.108,94	-665.293,09	-472,56%	-810.634,65	3.128.429,14	-810.646,20	79.826.375,32
IDN25P450400	-232.708,08	341.667,93	167.742,46	119,15%	232.685,93	-771.831,43	232.708,08	-19.658.478,25
IDN25P450500	-265.899,86	348.239,35	170.968,72	121,44%	265.797,41	-773.148,36	265.899,86	-19.658.920,57
IDN25P450600	299.189,38	353.766,08	-173.682,07	-123,37%	-298.854,50	774.367,56	-299.189,38	19.659.265,15
LCAMC3	3.007.234,80	1.014,25	-526,52	-0,37%	-1.562,29	1.264,14	2.933,74	-4.221,99
LF002100HDQ	3.154.643,38	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	1.597.286,65	47,25	-5,62	0,00%	-292,09	306,93	0,10	-0,16
LFT20250901 - 210100	10.957.546,76	2.688,12	-633,11	-0,45%	-14.632,55	17.534,98	-40,34	61,41
LFT20260301 - 210100	13.545.008,66	6.164,13	-1.792,22	-1,27%	-41.529,56	54.448,29	-3,71	5,65
LFT20260901 - 210100	9.535.743,57	6.273,90	-1.772,56	-1,26%	-43.343,54	60.025,79	15,38	-23,41
LFT20270301 - 210100	7.006.443,32	5.785,04	-1.464,20	-1,04%	-35.968,57	64.619,50	1.444,58	-2.198,76
LFT20290301 - 210100	4.580.706,87	5.475,51	-1.151,54	-0,82%	-35.298,89	96.541,48	4.977,06	-7.567,04
LTN20260701 - 100000	25.210.741,49	524.636,80	-273.782,69	-194,47%	-719.197,66	577.893,28	1.302.969,17	-1.861.513,16
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	11.855.724,00	32.668,61	-10.735,16	-7,63%	-51.700,46	46.928,90	14.004,16	-18.978,17
NTNB20250815 - 760199_NEGOCIACAO	1.759.855,44	61.888,17	13.884,32	9,86%	-201.131,84	192.815,61	254.218,71	-272.640,12
OMGE13	936.427,54	738,13	-355,72	-0,25%	-1.103,21	902,48	1.962,29	-2.712,24
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SBSPC7	2.340.439,20	1.218,69	-622,91	-0,44%	-1.845,02	1.492,15	3.986,89	-4.823,24
VAMO22	733.166,69	51,12	-27,54	-0,02%	-90,41	74,14	182,14	-267,33
WDOH25	-5.466,27	108.238,77	72.351,22	51,39%	130.091,25	-132.313,79	170.434,35	-171.229,17
Total Var:	137.492.570,75	18.727.183,24	140.783,58	100,00%	-792.174,07	231.752,35	1.474.124,90	4.270.665,97

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/01/2025

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

Dados Gerais							
PL:	64.896.490,10	VAR / PL:	0,1861%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	645,67
VAR:	120.743,65	ETL / PL:	0,2333%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	441,90
ETL:	151.417,40	VAR / CDI:	0,0021%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	209.630,50	Cenário Baixa - 10000 (+):	786.179,01	CENARIO BRADESCO 1 (+):	254.171,83	CENARIO BRADESCO 2 (+):	303.940,27
Cenário Alta - 09999 (-):	-733.311,80	Cenário Baixa - 10000 (-):	-333.717,22	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-302.169,87	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-291.323,45
Cenário Alta - 09999:	-523.681,30	Cenário Baixa - 10000:	452.461,78	CENARIO BRADESCO 1:	-47.998,04	CENARIO BRADESCO 2:	12.616,83

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CNH25	-768,40	4.363,16	3.363,70	2,79%	25.629,41	-26.098,27	34.479,89	-34.730,08
COMPROMISSADA_PRE	61.867,53	1,73	-0,24	0,00%	-1,73	1,76	7,76	-11,81
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-10.565,48	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DAPK29	567,25	20.362,01	13.176,89	10,91%	35.711,24	-32.502,41	-42.530,45	40.601,00
DAPK35	647,44	3.024,75	128,06	0,11%	8.233,80	-7.706,00	-11.394,06	10.045,74
DAPQ28	857,00	35.859,16	25.396,41	21,03%	53.473,25	-48.540,71	-61.648,00	59.405,88
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF26	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF27	-41,00	2.247,24	-1.725,78	-1,43%	-3.106,81	2.494,09	5.392,16	-7.535,63
DHF28	-39,43	2.982,94	2.224,36	1,84%	4.236,72	-3.500,84	-7.223,81	9.670,12
DHF29	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHL26	121,40	3.361,71	2.575,36	2,13%	4.717,87	-3.732,51	-8.481,64	12.118,23
DOLH25	-1.366,57	27.059,69	22.636,45	18,75%	32.522,81	-33.078,45	42.608,59	-42.807,29
EUPH25	204,68	5.005,45	-3.293,43	-2,73%	-171.657,58	-132.641,22	-251,89	229,60
LFT20270301 - 210100	18.098.648,59	14.943,59	-5.812,64	-4,81%	-92.911,98	166.921,44	3.731,57	-5.679,72
LFT20270901 - 210100	26.354.082,07	26.555,67	-9.515,55	-7,88%	-162.357,58	312.911,04	8.466,31	-12.884,47
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	328.201,69	904,36	-609,30	-0,50%	-1.431,22	1.299,13	387,68	-525,37
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	75.206,81	833,00	-593,82	-0,49%	-1.375,20	1.404,36	1.210,64	-1.610,75
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	39.031,77	703,54	-529,25	-0,44%	-915,40	932,16	901,55	-1.189,44
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	1.689.215,60	37.187,12	-25.936,31	-21,48%	-56.034,14	56.444,76	59.064,87	-76.700,96
NTNB20290515 - 760199_NEGOCIACAO	346.597,64	7.427,09	-4.678,70	-3,87%	-13.686,47	13.279,35	14.535,50	-18.715,34
NTNB20300815 - 760199_NEGOCIACAO	4.211,21	79,45	-35,05	-0,03%	-188,34	201,88	221,58	-280,87
NTNB20320815 - 760199_NEGOCIACAO	176.498,30	3.734,86	-877,50	-0,73%	-9.800,51	10.597,13	12.144,92	-15.034,68
NTNB20350515 - 760199_NEGOCIACAO	122.967,06	3.154,86	-160,19	-0,13%	-8.826,85	8.791,55	10.795,47	-13.000,89
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SWIH25	706,37	6.828,89	2.355,10	1,95%	32.096,27	-32.663,44	43.179,93	-43.493,24
UNI_PREV	17.585.967,40	28.206,86	25.840,86	21,40%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOH25	-546,63	10.823,88	9.054,58	7,50%	13.009,13	-13.231,38	17.043,44	-17.122,92
WING25	7.360,00	81.246,25	44.731,54	37,05%	-210.065,26	209.974,82	-169.494,74	170.715,03
WSPH25	-7.812,33	60.651,48	23.024,13	19,07%	-952,74	925,54	-1.145,29	1.154,66
Total Var:	64.872.820,00	387.559,72	120.743,65	100,01%	-523.681,30	452.461,78	-47.998,04	12.616,83

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00%		Duration DC:		3,00	
PL:	64.625.949,71	VAR / PL:	3,0669%	Status:		Duration DU:					
VAR:	1.961.891,84	ETL / PL:	3,8469%	Benchmark:							
ETL:	2.485.497,73	VAR / CDI:	0,0343%								

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	37.029.888,49	Cenário Baixa - 10000 (+):	1,09	CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.849.019,73	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-1,07	Cenário Baixa - 10000 (-):	-37.022.863,91	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-8.921.456,20
Cenário Alta - 09999:	37.029.887,42	Cenário Baixa - 10000:	-37.022.862,82	CENARIO BRADESCO 1:	8.849.019,73	CENARIO BRADESCO 2:	-8.921.456,20

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
AIEC11	2.829.917,75	374.599,56	279.339,12	14,09%	1.414.958,88	-1.414.958,88	414.865,94	-418.261,84
BMLC11	3.657.177,54	90.861,04	37.417,92	1,89%	3.657.177,54	-3.657.177,54	536.142,23	-540.530,84
BPML11	4.938.044,80	540.827,61	348.691,67	17,64%	4.938.044,80	-4.938.044,80	723.917,37	-729.843,02
BRCR11	469.295,00	23.677,67	20.573,92	1,04%	122.016,70	-122.016,70	68.798,65	-69.361,80
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBOP11	34.750,54	2.927,72	782,08	0,04%	17.375,27	-17.375,27	5.094,43	-5.136,13
CEOC11	482.842,50	27.300,36	10.193,05	0,51%	241.419,98	-241.421,25	70.784,71	-71.364,12
CNES11	192.224,88	14.793,27	7.558,35	0,38%	96.112,44	-96.112,44	28.180,17	-28.410,84
COMPROMISSADA PRE	38.283,24	1,07	0,26	0,00%	-1,07	1,09	4,80	-7,31
CONTAS A PAGAR RECEBER	-549.693,38	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
FIGS11	535.117,50	31.117,69	17.287,64	0,87%	267.558,75	-267.558,75	78.448,23	-79.090,37
FMOF11	7.025,85	2.688,37	-1.064,96	-0,05%	14.051,70	-7.025,85	1.029,99	-1.038,42
FVPQ11	500.517,85	128.368,10	55.630,18	2,81%	250.258,93	-250.258,93	73.375,92	-73.976,54
GARE11	540.755,57	38.737,50	26.632,74	1,34%	0,00	0,00	79.274,77	-79.923,67
GZIT11	120.232,00	17.745,79	15.908,83	0,80%	60.116,00	-60.116,00	17.626,01	-17.770,29
HSRE11	6.522.972,00	352.808,67	240.221,24	12,12%	6.522.972,00	-6.522.972,00	956.267,70	-964.095,26
JSRE11	83.458,22	4.868,97	1.290,10	0,07%	21.699,14	-21.699,14	12.234,98	-12.335,13
LASC11	5.752.477,00	245.035,20	159.692,93	8,06%	5.752.477,00	-5.752.477,00	843.313,13	-850.216,10
MALL11	5.131.753,08	283.971,37	244.692,96	12,35%	1.334.255,80	-1.334.255,80	752.315,00	-758.473,11
MAXR11	568.186,95	57.913,06	11.661,98	0,59%	284.093,48	-284.093,48	83.296,21	-83.978,03
NEWL11	5.397.565,80	247.027,06	-14.962,43	-0,75%	2.698.782,90	-2.698.782,90	791.283,15	-797.760,23
NEWU11	1.783.449,98	278.931,26	-52.955,02	-2,67%	1.783.449,98	-1.783.449,98	261.453,77	-263.593,91
OULG11	383.604,57	42.472,42	7.334,07	0,37%	191.802,29	-191.802,29	56.236,43	-56.696,76
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	3.447.180,00	140.872,19	-67.910,76	-3,43%	1.723.590,00	-1.723.590,00	505.356,59	-509.493,20
PQDP11	499.510,00	27.525,79	-3.282,67	-0,17%	249.755,00	-249.755,00	73.228,17	-73.827,58
QAQR11	1.862.261,00	49.334,55	29.989,17	1,51%	931.130,50	-931.130,50	273.007,46	-275.242,18
RBRP11	1.836.937,02	133.694,49	62.538,91	3,16%	918.468,51	-918.468,51	269.294,97	-271.499,29
RCRB11	4.774.730,00	555.256,13	466.193,59	23,52%	0,00	0,00	0,00	0,00
SARE11	2.431.492,00	158.407,03	76.970,51	3,88%	1.215.746,00	-1.215.746,00	356.456,73	-359.374,52
VSHO11	23.259,60	1.480,66	1.334,58	0,07%	11.629,80	-11.629,80	3.409,86	-3.437,77
VVMR11	5.707.730,57	485.334,37	-137.392,49	-6,93%	0,00	0,00	836.753,30	-843.602,58
XPIN11	2.681.723,00	222.489,41	177.713,91	8,97%	1.340.861,50	-1.340.861,50	393.140,59	-396.358,66
XPPR11	1.940.167,25	94.869,78	-41.089,56	-2,07%	970.083,63	-970.083,63	284.428,52	-286.756,72
Total Var:	64.625.949,68	4.675.938,37	1.981.991,84	100,01%	37.029.887,42	-37.022.862,82	8.849.019,73	-8.921.456,20

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB II
CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		3,00	
PL:	93.832.645,56	VAR / PL:	6,6759%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	1,00
VAR:	6.264.148,28	ETL / PL:	8,3718%	Benchmark:			
ETL:	7.855.494,66	VAR / CDI:	0,0748%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	23.013.378,38	Cenário Baixa - 10000 (+):	20,26	CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.348.737,75	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-19,87	Cenário Baixa - 10000 (-):	-23.152.954,18	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-13.458.050,17
Cenário Alta - 09999:	23.013.358,51	Cenário Baixa - 10000:	-23.152.933,91	CENARIO BRADESCO 1:	13.348.737,75	CENARIO BRADESCO 2:	-13.458.050,17

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	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	2.367.685,50	306.585,19	-16.240,87	-0,26%	331.475,97	-710.305,65	347.102,69	-349.943,92
AZ3A3	478.100,00	128.768,38	111.162,94	1,77%	0,00	0,00	0,00	0,00
B3SA3	2.445.339,51	257.205,30	114.319,23	1,82%	611.334,88	-611.334,88	358.466,77	-361.421,18
BBAS3	4.110.480,00	609.311,48	529.470,77	8,45%	1.027.620,00	-1.027.634,85	602.596,37	-607.528,94
BBD44	1.836.229,20	244.416,76	200.909,57	3,21%	459.057,30	-459.072,49	269.191,20	-271.394,68
BBSE3	1.055.996,00	63.965,14	27.522,16	0,44%	211.199,20	-211.199,20	154.809,01	-156.076,21
BPAC11	2.693.539,00	552.130,11	507.823,50	8,11%	808.061,70	-942.738,65	394.872,82	-398.105,06
BRFS3	641.377,00	149.794,18	-53.531,68	-0,85%	160.344,25	-160.344,25	94.025,87	-94.795,52
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMG4	471.608,80	32.160,17	4.436,89	0,07%	117.902,20	-141.482,64	69.137,85	-69.703,78
COMPROMISSADA_PRE	710.766,82	19,87	7,38	0,00%	-19,87	20,26	89,16	-135,70
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.578.876,31	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	752.922,00	65.110,02	56.979,08	0,91%	150.584,40	-150.584,40	110.375,87	-111.281,87
CPLES	1.716.900,00	135.308,27	123.553,94	1,97%	377.715,00	-377.715,00	251.637,54	-253.757,82
CXSE3	553.436,00	53.420,31	23.152,12	0,37%	110.687,20	-110.687,20	81.133,72	-81.797,84
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIRR3	1.292.222,00	198.160,27	190.629,31	3,04%	387.666,60	-387.666,60	189.439,75	-190.990,41
ELET3	3.916.558,98	357.132,95	274.624,29	4,38%	1.174.967,69	-1.174.967,69	574.167,55	-578.867,42
ENEV3	377.600,00	64.716,56	53.451,88	0,85%	139.712,00	-192.576,00	55.356,16	-55.809,28
ENG11	725.778,00	86.216,83	78.220,06	1,25%	123.382,26	-159.671,16	106.399,06	-107.269,99
EQTL3	2.375.820,00	328.897,10	312.909,45	5,00%	475.164,00	-475.164,00	348.295,21	-351.146,20
GGBR4	537.608,40	88.845,70	15.881,22	0,25%	134.402,10	-134.405,22	78.813,39	-79.458,52
GMAT3	740.812,00	98.099,88	60.963,06	0,97%	133.346,16	-118.541,01	108.603,04	-109.492,01
HAPV3	297.418,00	78.954,06	64.099,95	1,02%	101.122,12	-101.134,41	43.601,48	-43.958,38
IGTI11	567.644,00	62.767,13	59.849,83	0,96%	113.528,80	-113.528,80	83.216,61	-83.897,78
ITSA4	2.700.192,08	317.678,97	289.967,89	4,63%	513.008,16	-513.036,50	395.848,16	-399.088,39
ITUB4	8.572.085,97	1.048.012,91	969.331,52	15,47%	1.714.417,19	-1.628.696,33	1.256.667,80	-1.266.954,31
JBSS3	2.222.088,00	395.307,56	-115.027,57	-1,84%	777.730,80	-777.737,07	325.758,10	-328.424,61
LREN3	845.139,75	153.577,87	135.214,91	2,16%	169.027,95	-169.027,95	123.897,49	-124.911,66
LWSA3	628.320,00	77.085,93	50.647,25	0,81%	251.328,00	-251.328,00	92.111,71	-92.965,70
MRF33	1.117.087,00	252.566,43	-115.855,18	-1,05%	446.828,80	-335.120,10	163.762,02	-165.102,50
NTCO3	619.642,00	51.062,54	23.674,31	0,38%	154.910,50	-154.910,50	90.839,52	-91.583,09
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	2.024.190,00	120.602,39	58.233,19	0,93%	506.047,50	-607.257,00	296.746,25	-299.175,28
PETR4	9.658.401,71	488.859,09	213.851,32	3,41%	2.414.600,43	-2.897.546,14	1.415.921,69	-1.427.511,77
PRIO3	1.336.274,00	115.217,19	38.517,91	0,61%	708.225,22	-440.973,68	195.897,77	-197.501,30
RADL3	721.193,64	66.398,33	37.087,28	0,59%	144.238,73	-144.238,73	105.726,99	-106.592,42
RAIL3	1.153.680,00	106.511,67	57.802,57	0,92%	519.156,00	-380.714,40	169.129,49	-170.513,90
RDOR3	2.342.210,00	326.480,54	279.900,51	4,47%	702.663,00	-702.671,38	343.367,99	-346.178,64
RENT3	2.556.036,00	388.718,64	213.968,98	3,42%	843.491,88	-664.569,36	374.714,88	-377.782,12
S BSP3	3.168.095,00	318.293,50	277.959,44	4,44%	792.023,75	-792.023,75	464.442,73	-468.244,44
SRNA3	517.036,00	135.066,96	116.372,79	1,86%	0,00	0,00	75.797,48	-76.417,92
SUZB3	3.711.015,00	254.004,87	-50.075,88	-0,80%	927.753,75	-742.203,00	544.034,80	-548.488,02
TIMS3	983.430,00	131.103,27	119.182,16	1,90%	314.697,60	-226.188,90	144.170,84	-145.350,95
TOTS3	391.690,00	72.227,70	65.955,14	1,05%	78.338,00	-78.338,00	57.421,75	-57.891,78
VALE3	10.248.693,15	651.062,41	455.439,70	7,27%	2.562.173,29	-2.562.173,29	1.502.458,42	-1.514.756,85
YBBR3	604.114,00	47.695,09	41.911,72	0,67%	126.028,50	-126.028,50	73.903,11	-74.508,05
VIVT3	1.919.190,00	235.108,01	217.414,88	3,47%	287.878,50	-287.878,50	281.353,25	-283.656,28
WEGE3	3.638.144,00	277.567,59	142.479,39	2,27%	909.536,00	-909.536,00	533.351,91	-537.717,68
Total Var:	93.832.644,82	9.992.215,14	6.264.148,28	99,97%	23.013.358,51	-23.152.933,91	13.348.737,75	-13.458.050,17

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB III
CNPJ: 38452593000108

Dados Gerais	
PL:	101.748.996,62
VAR:	10.610.676,86
ETL:	13.306.216,86
VAR / PL:	10,4283%
ETL / PL:	13,0775%
VAR / CDI:	0,1168%
Limite Fundo:	0,00%
Status:	ENQUADRADO
Benchmark:	
Dutacion DC:	3,00
Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	26.186.098,44	Cenário Baixa - 10000 (+):	661.682,92	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.382.218,73
Cenário Alta - 09999 (-):	-650.568,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-24.495.330,23	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-852.171,74
Cenário Alta - 09999:	25.535.530,43	Cenário Baixa - 10000:	-23.833.647,31	CENARIO BRADESCO 1:	13.530.047,00
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	856.145,85
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	-14.498.371,71
				CENARIO BRADESCO 2:	-13.642.225,86

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALOS3	4.676.926,00	527.044,39	510.946,42	4,82%	0,00	0,00	685.637,35	-691.249,66
ALPA4	1.166.840,00	103.665,52	31.068,14	0,29%	291.710,00	-291.710,00	171.058,74	-172.458,95
ASAI3	1.547.504,00	435.287,65	420.367,72	3,96%	433.301,12	-402.351,04	226.864,09	-228.721,09
AZZA3	3.047.785,05	820.870,82	791.387,31	7,46%	0,00	0,00	0,00	0,00
BBAS3	1.490.457,28	220.935,93	202.466,93	1,91%	372.614,32	-372.619,71	218.501,04	-220.289,59
BPAC11	1.731.779,47	354.985,61	347.578,36	3,28%	519.533,84	-606.122,81	253.878,87	-255.957,01
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	3.996.788,14	111,76	40,78	0,00%	-111,74	113,95	501,36	-763,07
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	119.834,21	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.862.062,37	218.215,20	180.894,70	1,70%	629.620,71	-629.653,72	419.578,34	-423.012,82
CPLE6	4.064.949,90	320.357,22	279.668,65	2,64%	894.288,98	-894.288,98	595.921,66	-600.799,60
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLH25	27.331,36	541.193,87	468.334,83	4,41%	-650.456,26	661.568,97	-852.171,74	856.145,85
ELET3	2.705.198,13	246.674,54	195.433,77	1,84%	811.559,44	-811.559,44	396.582,05	-399.828,28
ENEV3	2.744.857,00	470.438,85	406.504,29	3,83%	1.015.597,09	-1.399.877,07	402.396,04	-405.689,87
ENH11	4.862.316,00	577.605,62	556.397,24	5,24%	826.593,72	-1.069.709,52	712.815,53	-718.650,31
EQTL1	5.130,00	5.437,18	4.938,44	0,05%	0,00	0,00	752,06	-758,21
EQTL3	10.139.414,85	1.403.651,83	1.338.971,59	12,62%	2.027.882,97	-2.027.882,97	1.486.438,22	-1.498.605,52
FLRY3	1.174.528,00	69.162,67	51.261,89	0,48%	234.905,60	-234.905,60	172.185,81	-173.595,24
GGPS3	1.555.962,00	215.653,77	207.206,33	1,95%	700.172,52	-700.182,90	228.104,03	-229.971,18
HAPV3	4.371.570,28	1.160.498,70	1.068.798,92	10,07%	1.486.333,90	-1.486.514,54	640.872,20	-646.118,09
IGT11	7.604.347,01	840.849,26	814.643,90	7,68%	1.520.869,40	-1.520.869,40	1.114.797,27	-1.123.922,49
ITSA4	5.065.147,35	595.917,17	577.108,79	5,44%	962.324,85	-962.378,00	742.550,60	-748.628,78
NTCO3	2.875.706,78	236.977,00	84.474,86	0,80%	718.926,70	-718.926,70	421.578,61	-425.029,46
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETRA	746.282,00	37.771,98	9.847,10	0,09%	186.565,50	-223.890,58	109.402,01	-110.297,52
PRIO3	3.943.606,91	340.028,54	143.623,43	1,35%	2.090.111,66	-1.301.399,90	578.132,77	-582.865,10
RAI13	5.453.649,60	503.499,54	233.910,87	2,20%	2.454.142,32	-1.799.704,37	799.505,03	-806.049,41
RECV3	184.409,40	14.273,25	4.463,04	0,04%	110.645,64	-110.645,64	27.034,42	-27.255,71
RENT3	6.816.466,44	1.036.639,37	692.938,80	6,53%	2.249.433,93	-1.772.281,27	999.293,98	-1.007.473,74
SCAR3	105.616,00	8.156,60	-1.257,76	-0,01%	63.369,60	-63.369,60	15.483,31	-15.610,05
SMFT1	17.226,81	67.138,25	-32.474,72	-0,31%	0,00	0,00	0,00	0,00
SMFT3	5.421.284,00	1.006.009,64	940.959,09	8,87%	2.168.513,60	-2.168.513,60	794.760,23	-801.265,78
SUZB3	5.750.950,59	393.630,71	-171.001,90	-1,61%	1.437.737,65	-1.150.190,12	843.089,36	-849.990,50
VALE3	1.895.950,00	120.446,55	61.991,64	0,58%	473.987,50	-473.987,50	277.946,27	-280.221,41
VBBR3	2.090.640,00	197.799,05	167.719,98	1,58%	522.660,00	-522.660,00	306.487,82	-308.996,59
WDOG25	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOH25	-16.672,13	330.128,26	-285.684,24	-2,69%	396.778,32	-403.557,07	519.824,76	-522.248,97
YDUQ3	1.502.352,75	336.125,77	307.147,66	2,89%	585.917,57	-375.588,19	220.244,91	-222.047,74
Total Var:	101.749.177,55	13.757.182,07	10.610.676,86	99,98%	25.535.530,43	-23.833.647,31	13.530.046,99	-13.642.225,86

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/01/2025

FUNDO: FIA RVA EMB IV
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais							
PL:	91.453.939,27	VAR / PL:	10,2410%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	3,00
VAR:	9.365.800,07	ETL / PL:	12,8426%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00
ETL:	11.745.091,14	VAR / CDI:	0,1147%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	25.065.086,35	Cenário Baixa - 10000 (+):	142,50	CENARIO BRADESCO 1 (+):	12.617.396,92	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-139,74	Cenário Baixa - 10000 (-):	-21.790.605,83	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-12.720.999,26
Cenário Alta - 09999:	25.064.946,61	Cenário Baixa - 10000:	-21.790.463,33	CENARIO BRADESCO 1:	12.617.396,92	CENARIO BRADESCO 2:	-12.720.999,26

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	4.998.262,31	139,76	47,43	0,00%	-139,74	142,50	626,99	-954,27
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	392.121,03	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	1.391.994,51	106.131,29	90.180,75	0,96%	306.222,74	-306.238,79	204.066,40	-205.736,79
CPLE6	819.388,10	64.575,68	57.807,05	0,62%	180.265,38	-180.265,38	120.122,30	-121.105,56
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENGH1	11.203.236,12	1.330.858,00	1.295.563,90	13,83%	1.904.550,14	-2.464.711,95	1.642.394,42	-1.655.838,30
ENGH4	13,94	1,31	1,18	0,00%	11,15	-11,15	2,04	-2,06
EQTL1	7.372,00	7.813,43	7.133,87	0,08%	0,00	0,00	1.080,74	-1.089,58
EQTL3	13.657.256,55	1.890.644,92	1.828.874,41	19,53%	2.731.451,31	-2.731.451,31	2.002.153,81	-2.018.542,52
GGPS3	4.607.056,58	638.530,45	615.640,23	6,57%	2.073.144,73	-2.073.175,46	675.394,50	-680.922,96
GMAT3	4.731.697,84	626.581,36	315.897,42	3,37%	851.705,61	-757.142,49	693.666,90	-699.344,94
HAPV3	4.431.562,08	1.176.424,42	1.068.784,82	11,41%	1.506.731,11	-1.506.914,23	649.667,00	-654.984,88
ITUB4	6.773.292,54	828.094,59	804.506,14	8,59%	1.354.658,51	-1.286.925,58	992.964,69	-1.001.092,64
MATD3	585.152,84	75.768,46	70.801,62	0,76%	175.545,85	-175.545,85	85.783,41	-86.485,59
MULT3	6.447.638,40	804.963,64	782.051,09	8,35%	1.934.291,52	-1.611.909,60	945.223,79	-952.960,96
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	9.971.145,42	859.739,34	355.653,45	3,80%	5.284.707,07	-3.290.502,31	1.461.769,92	-1.473.735,29
RAIL3	6.121.588,00	565.165,89	277.706,06	2,97%	2.754.714,60	-2.020.124,04	897.424,80	-904.770,71
RENT3	2.232.549,27	339.523,20	213.669,05	2,28%	736.741,26	-580.462,81	327.291,72	-329.970,78
SBSP3	3.778.071,50	379.576,88	336.172,13	3,59%	944.517,88	-944.517,88	553.865,28	-558.398,97
UGPA3	9.303.534,98	1.324.566,51	1.245.309,46	13,30%	2.325.827,50	-1.860.707,00	1.363.898,23	-1.375.062,47
Total Var:	91.453.934,01	11.019.099,12	9.365.800,07	100,01%	25.064.946,61	-21.790.463,33	12.617.396,92	-12.720.999,26

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/01/2025

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00%		Dutacion DC:		3,69	
PL:	116.197.078,01	VAR / PL:	6,8521%	Status:		Dutacion DU:					
VAR:	7.961.940,22	ETL / PL:	8,5929%	Benchmark:							1,47
ETL:	9.984.594,25	VAR / CDI:	0,0767%								

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	29.176.714,99	Cenário Baixa - 10000 (+):	633,11	CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.718.406,68	CENARIO BRADESCO 2 (+):	2,15
Cenário Alta - 09999 (-):	-531,19	Cenário Baixa - 10000 (-):	-29.490.437,35	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-1,41	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-16.855.071,38
Cenário Alta - 09999:	29.176.183,80	Cenário Baixa - 10000:	-29.489.804,24	CENARIO BRADESCO 1:	16.718.405,27	CENARIO BRADESCO 2:	-16.855.069,23

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	2.704.870,20	350.246,33	-31.006,74	-0,39%	378.681,83	-811.461,06	396.533,97	-399.779,82
ALOS3	502.569,00	56.634,67	51.449,70	0,65%	0,00	0,00	73.676,62	-74.279,70
AMOB3	9.406,95	27.486,08	-20.105,44	-0,25%	0,00	0,00	0,00	0,00
ASAI3	502.985,98	141.481,76	126.427,73	1,59%	140.836,07	-130.776,36	73.737,75	-74.341,33
AURE3	145.590,72	14.042,33	1.982,00	0,02%	43.675,42	-45.134,92	21.343,60	-21.518,31
AZUL4	83.388,80	36.378,86	30.167,31	0,38%	50.033,28	-29.186,08	12.224,80	-12.324,87
AZZA3	258.891,15	69.728,08	60.979,90	0,77%	0,00	0,00	0,00	0,00
B3SA3	3.345.843,57	351.921,98	163.382,95	2,05%	836.460,89	-836.460,89	490.500,67	-494.515,68
BBSA3	4.362.921,60	646.731,83	572.622,66	7,19%	1.090.730,40	-1.090.746,16	639.604,31	-644.839,81
BBDC3	907.056,20	105.279,80	84.527,00	1,06%	226.764,05	-226.764,05	132.974,44	-134.062,91
BBDC4	3.438.988,41	457.756,80	385.193,49	4,84%	859.747,10	-859.775,55	504.155,70	-508.282,49
BBSE3	1.361.772,36	82.487,01	36.195,15	0,45%	272.354,47	-272.354,47	193.635,63	-201.269,96
BEER3	70.121,92	10.569,73	2.963,62	0,04%	17.530,48	-17.530,48	10.279,87	-10.264,02
BPAC11	2.324.814,03	476.547,70	442.357,86	5,56%	697.444,21	-813.684,91	340.817,74	-343.607,51
BRAP4	231.684,75	17.887,84	12.757,44	0,16%	57.921,19	-57.922,58	33.964,98	-34.243,01
BRAV3	573.086,50	100.379,15	-28.486,04	-0,36%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRFS3	988.530,51	230.872,20	-91.491,94	-1,15%	247.132,63	-247.132,63	144.918,57	-146.104,81
BRKM5	203.241,77	74.497,55	69.307,37	0,87%	111.782,97	-60.972,53	29.795,24	-30.039,13
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CCRO3	617.694,92	92.295,68	82.884,02	1,04%	154.423,73	-154.423,73	90.554,08	-91.295,31
CMG4	1.129.493,76	77.022,96	7.400,77	0,09%	282.373,44	-338.848,13	165.583,79	-166.939,18
CMN3	498.492,54	68.471,06	52.277,66	0,66%	174.472,39	-174.472,39	73.079,01	-73.677,20
COGN3	146.397,48	49.490,49	42.396,83	0,53%	36.599,37	-51.239,12	21.461,87	-21.637,55
COMPROMISSADA PRE	688.959,87	19,26	7,35	0,00%	-19,26	19,64	86,42	-131,54
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	1.305.065,70	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	357.998,94	30.958,48	27.534,15	0,35%	71.599,79	-71.599,79	52.482,65	-52.912,24
CPLES	903.196,10	71.190,56	65.349,44	0,82%	198.703,14	-198.703,14	132.408,55	-133.492,38
CRFB3	182.821,65	41.764,90	36.196,43	0,45%	45.705,41	-45.705,41	26.801,65	-27.021,04
CSAN3	493.935,84	63.052,67	45.877,65	0,58%	123.483,96	-123.483,96	72.410,99	-73.003,72
CSDA3	366.617,88	96.162,63	62.697,41	0,79%	146.643,12	-109.989,40	53.746,18	-54.186,12
CVCB3	56.275,02	26.835,08	22.339,67	0,28%	28.137,51	-28.137,51	8.249,92	-8.317,45
CXSE3	421.257,28	40.661,79	16.214,26	0,20%	84.251,46	-84.251,46	61.756,32	-62.261,83
CYRE3	310.168,26	69.012,81	64.436,86	0,81%	99.253,84	-89.950,31	45.470,67	-45.842,87
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EGIE3	520.867,20	41.317,94	37.408,03	0,47%	93.756,10	-93.756,10	76.359,13	-76.984,17
ELET3	3.956.438,43	360.769,38	284.822,06	3,58%	1.186.931,53	-1.186.931,53	580.013,87	-584.761,60
ELET6	591.966,70	48.832,15	37.616,22	0,47%	177.590,01	-177.590,01	86.782,32	-87.492,68
EMBR3	2.431.879,50	193.694,51	68.407,25	0,86%	607.969,88	-607.969,88	356.513,54	-359.431,79
ENEV3	1.262.493,80	216.377,80	180.217,52	2,26%	467.122,71	-643.871,84	185.081,59	-186.596,58
ENGI1	717.211,44	85.199,18	77.551,95	0,97%	121.925,95	-157.786,52	105.143,20	-106.003,85
EQT11	584,25	619,23	546,03	0,01%	0,00	0,00	85,65	-86,35
EQT13	2.088.369,90	289.103,89	273.063,12	3,43%	417.673,98	-417.673,98	306.155,03	-308.661,07
FLRY3	299.871,88	17.658,09	13.613,48	0,17%	59.974,34	-59.974,34	43.961,19	-44.321,03
GGBR4	1.186.475,22	196.078,07	27.621,30	0,35%	296.618,81	-296.625,70	173.937,27	-175.361,04
GOAU4	347.022,26	58.443,72	6.293,81	0,08%	104.106,68	-86.755,57	50.873,46	-51.289,89
HAPV3	641.316,94	170.247,17	141.674,68	1,78%	218.047,76	-218.074,26	94.011,06	-94.786,64
HYPE3	375.690,56	71.025,59	41.891,92	0,53%	86.408,83	-78.895,02	55.076,24	-55.527,07
IGT11	216.460,35	23.935,06	22.721,85	0,29%	43.292,07	-43.292,07	31.733,09	-31.992,84
IRBR3	239.795,70	69.825,60	39.409,65	0,49%	155.867,21	-131.888,09	35.154,05	-35.441,80
ISAE4	522.267,20	40.476,08	38.422,66	0,48%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	3.053.316,70	359.224,27	331.855,46	4,17%	580.098,13	-580.130,17	447.616,23	-451.280,21
ITUB4	8.985.041,31	1.098.500,33	1.028.245,17	12,91%	1.797.008,26	-1.707.157,85	1.317.207,06	-1.327.989,11
JBS53	2.252.034,80	400.635,07	-133.654,05	-1,68%	788.212,18	-788.218,53	330.148,30	-332.850,74
KLBN11	952.869,72	113.272,05	-52.178,69	-0,66%	238.217,43	-190.573,94	139.690,70	-140.834,15
LFT20250901 - 210100	383.354,41	94,05	78,11	0,00%	-511,93	613,47	-1,41	2,15
LENR3	795.617,55	144.578,75	127.942,21	1,61%	159.123,51	-159.123,51	116.637,53	-117.592,27
LWSA3	72.582,72	8.994,87	5.749,60	0,07%	29.033,09	-29.033,09	10.640,63	-10.727,73
MGLU3	146.201,98	43.194,45	36.471,76	0,46%	76.024,56	-65.790,49	21.433,08	-21.608,52
MIRF3	266.930,38	68.148,89	-29.739,86	-0,37%	106.412,15	-79.808,11	39.000,05	-39.519,29
MRVE3	117.983,16	25.459,43	11.548,56	0,15%	35.394,05	-35.397,04	17.296,33	-17.437,91
MULT3	390.185,60	48.713,22	45.428,08	0,57%	117.055,68	-97.546,40	57.201,21	-57.669,43
NTCO3	595.424,22	49.066,84	21.773,98	0,27%	148.856,06	-148.856,06	87.289,19	-88.003,70
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PCAR3	69.257,70	15.273,15	15.013,96	0,06%	25.071,29	-25.071,29	10.153,18	-10.236,29
PETR3	5.209.415,40	310.379,93	158.805,73	1,99%	1.302.353,85	-1.562.824,62	763.700,30	-769.951,60
PETR4	9.260.244,55	468.706,40	207.703,04	2,61%	2.315.061,14	-2.778.097,94	1.357.551,85	-1.368.664,14
PETZ3	76.381,34	18.227,29	13.690,28	0,17%	29.024,91	-38.954,48	11.197,50	-11.289,16
POMO4	307.793,50	64.087,11	52.821,58	0,66%	76.948,38	-76.948,38	45.122,53	-45.491,88
PRIO3	1.772.694,53	152.846,55	58.279,56	0,73%	939.528,10	-584.993,52	259.877,02	-262.004,25
PSSA3	404.698,80	37.494,10	31.306,53	0,39%	64.751,81	-64.751,81	59.328,84	-59.814,48
RADL3	1.504.518,42	138.516,91	73.321,36	0,92%	300.903,68	-300.903,68	220.562,40	-222.367,82
RALL3	1.241.632,00	114.631,70	57.579,55	0,72%	558.734,40	-409.738,56	182.023,25	-183.513,21
RAZI3	126.310,10	10.959,98	5.026,98	0,06%	44.208,54	-44.208,54	18.517,06	-18.668,63
RDOV3	1.774.880,90	247.400,56	215.866,69	2,71%	532.464,27	-532.470,52	260.197,54	-262.327,40
RECV3	242.144,46	18.741,94	4.050,28	0,05%	145.286,68	-145.286,68	35.498,38	-35.788,95
RENT3	1.653.397,20	251.446,50	136.845,64	1,72%	545.621,08	-429.883,27	242.388,03	-244.372,11
SANB11	513.281,12	70.247,66	61.594,69	0,77%	102.656,22	-102.656,22	75.247,01	-75.862,95
SBP3	3.584.486,71	360.122,72	317.729,83	3,99%	896.121,68	-896.121,68	525.485,75	-529.787,14
SLE3	187.019,28	16.929,91	3.380,50	0,04%	56.105,78	-56.106,86	27.417,03	-27.641,45
SMT03	161.235,14	8.818,23	-93,37	0,00%	48.370,54	-48.370,54	23.637,07	-23.830,55
STBP3	625.325,10	39.930,89	6.272,73	0,08%	218.863,79	-218.863,79	91.672,66	-92.423,05
SUZB3	2.181.328,38	149.303,64	-34.846,90	-0,44%	545.332,10	-436.265,68	319.782,74	-322.400,34
TAE11	406.007,16	16.027,77	8.574,23	0,11%	101.500,58	-101.501,79	59.520,65	-60.007,86

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais									
PL:	116.197.078,01	VAR / PL:	6,8521%	Limite Fundo:		0,00%	Dutacion DC:		3,69
VAR:	7.961.940,22	ETL / PL:	8,5928%	Status:	ENQUADRADO		Dutacion DU:		1,47
ETL:	9.984.594,25	VAR / CDI:	0,0767%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	29.176.714,99	Cenário Baixa - 10000 (+):	633,11	CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.718.406,68	CENARIO BRADESCO 2 (+):	2,15		
Cenário Alta - 09999 (-):	-531,19	Cenário Baixa - 10000 (-):	-29.490.437,35	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-1,41	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-16.855.071,38		
Cenário Alta - 09999:	29.176.183,80	Cenário Baixa - 10000:	-29.489.804,24	CENARIO BRADESCO 1:	16.718.405,27	CENARIO BRADESCO 2:	-16.855.069,23		

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
TIMS3	698.968,97	93.181,13	85.871,21	1,08%	223.670,07	-160.762,86	102.468,85	-103.307,61
TOTS3	1.020.233,24	188.131,17	171.088,09	2,15%	204.046,65	-204.046,65	149.566,19	-150.790,47
UGPA3	999.843,00	142.350,04	129.322,52	1,62%	249.954,71	-199.968,60	146.576,98	-147.776,80
USIM5	157.409,68	26.854,25	20.391,05	0,26%	61.389,78	-34.632,99	23.076,26	-23.265,15
VALE3	12.828.106,04	814.948,22	560.766,39	7,04%	3.207.026,51	-3.207.026,51	1.880.600,35	-1.895.994,07
VAMO3	130.200,84	21.432,97	16.461,47	0,21%	45.570,29	-52.080,34	19.087,44	-19.243,68
VBBR3	956.906,16	90.534,54	79.219,58	0,99%	239.226,54	-239.226,54	140.282,44	-141.430,73
VIVA3	149.152,80	30.145,69	28.655,82	0,36%	44.745,84	-44.745,84	21.865,80	-22.044,78
VIVT3	1.099.747,74	134.723,25	125.702,34	1,58%	164.962,16	-164.962,16	161.223,02	-162.542,72
WEGE3	3.794.072,32	289.463,94	143.505,67	1,80%	948.518,08	-948.518,08	556.211,00	-560.763,89
WING25	-10.080,00	111.272,04	111.256,64	1,40%	287.698,08	-287.574,21	232.134,10	-233.805,37
YDUQ3	157.778,25	35.300,19	27.138,16	0,34%	61.533,52	-39.444,56	23.130,29	-23.319,63
Total Var:	116.196.883,26	12.701.819,12	7.961.940,22	99,97%	29.176.183,80	-29.489.804,23	16.718.405,27	-16.855.069,23



Data: 31/01/2025

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA EMB VIII ETF
CNPJ: 45622039000189

Dados Gerais									
PL:	86.949.136,19	VAR / PL:	6,8636%	Limite Fundo:		0,00%	Dutacion DC:		3,00
VAR:	5.967.804,83	ETL / PL:	8,6072%	Status:	ENQUADRADO		Dutacion DU:		1,00
ETL:	7.483.868,02	VAR / CDI:	0,0769%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	7.791.737,94	Cenário Baixa - 10000 (+):	6,32	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.345.965,50	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	-6,20	Cenário Baixa - 10000 (-):	-7.791.737,94	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-6.397.924,94		
Cenário Alta - 09999:	7.791.731,74	Cenário Baixa - 10000:	-7.791.731,62	CENARIO BRADESCO 1:	6.345.965,50	CENARIO BRADESCO 2:	-6.397.924,94		

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
BOVA11	43.419.000,00	2.991.206,11	2.990.651,07	50,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
BOVV11	43.287.433,00	2.977.708,92	2.977.151,40	49,89%	7.791.737,94	-7.791.737,94	6.345.937,68	-6.397.882,60
CAXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	221.788,25	6,20	2,36	0,00%	-6,20	6,32	27,82	-42,34
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	11.914,71	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
Total Var:	86.949.135,96	5.968.921,24	5.967.804,83	100,00%	7.791.731,74	-7.791.731,62	6.345.965,50	-6.397.924,94

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 – JANEIRO 2025



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2025

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS			Emissor	Financeiro	INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento			S&P	Moody's	Fitch
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.495.622,55	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	728.503,93	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.581.964,12	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.230.728,08	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	3.246.238,18	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	13.111.005,86	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	27.931.328,07	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	645.851,88	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	645.851,88	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	645.851,88	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	644.790,37	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	645.851,88	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	6.668.671,27	brAAA	A2.br	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	7.682.698,99	brA	Aa1.br	AA(bra)
FIR F EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	2.772.761,74	-	Aa3.br	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMG	754.722,42	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	596.721,89	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.778.282,39	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.151.641,45	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.505.129,32	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	763.517,88	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	6.177.553,77	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	9.162.214,59	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	943.985,75	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	652.664,57	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	88.053,89	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.344.835,68	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.355.473,75	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.617.674,18	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	674.437,81	brAAA+	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.704.248,39	brAAA+	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.912.158,88	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.664.894,51	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.921.071,15	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.552.583,85	brAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	24.325.599,97	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	762.385,08	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.811.276,68	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.155.733,20	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	772.646,11	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	5.248.340,98	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.769.552,92	brAAA+	-	-
FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	4.887.376,30	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	168.169,71	-	-	AAA(bra)
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	168.169,71	-	-	AAA(bra)
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	138.095,58	-	-	AA-
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	280.682,08	-	-	AA-
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	276.471,85	-	-	AA-
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	504.163,10	-	-	AAA(bra)
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	16/06/25	BNBBM	604.171,08	brAAA	AAbr	AA(bra)
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	09/06/25	BNBBM	907.648,78	brAAA	AAbr	AA(bra)
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	386.328,80	-	-	AA-(bra)
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	531.688,04	-	-	AA(bra)
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.438.454,96	-	-	AA-(bra)
FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	994.213,64	-	A.br	-
FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.879.488,52	-	A.br	-
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	580.083,49	brAAA	-	-
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	122.679,46	brAAA	-	-
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	254.556,36	brAAA+	-	AAA(bra)
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.940.503,33	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.175.366,97	brAAA+	-	-
FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.056.606,81	brAAA+	-	-
FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	549.435,54	brAAA+	-	-
FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.350.733,94	brAAA+	-	-
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	670.439,54	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	855.418,33	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	910.439,21	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	709.454,85	brAAA+	-	AA-(bra)
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.401.087,45	brAAA+	-	-
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	335.675,11	brA	-	-
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	611.434,91	brAA	-	-
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.083.319,68	-	-	AAA(bra)
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	ALTOPIST	884.838,76	brAAA	-	-
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.646.892,06	-	-	AA(bra)
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.134.132,74	brAA	-	-
FIRENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.077.542,09	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	674.634,59	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	60.415,04	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	302.075,19	-	-	AA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2025

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB 1A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.038.400,23	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	995.000,67	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	845.672,10	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	434.302,79	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	434.302,79	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCALIZA	3.556.944,52	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCALIZA	4.311.447,90	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	854.085,15	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	600.494,72	brAA	-	-
FIM EMB 1A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	3.146.238,38	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	858.489,82	brAA+	-	-
FIM EMB 1A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.838.508,84	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.037.060,51	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.476.815,90	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	06/06/25	BNBMM	604.599,67	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	273.275,14	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.116.945,04	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	680.102,32	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	635.505,45	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.541.452,92	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	1.025.446,66	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	3.665,23	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	750.007,02	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	814.225,51	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	510.710,91	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	1.838.530,66	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	866.703,80	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	70.710,10	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	757.348,54	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	856.407,21	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	631.898,45	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.646.246,51	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.616.584,04	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.286.008,47	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.705.425,29	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.809.298,47	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.555.598,26	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	15/06/42	15/06/42	BRK AMBI	2.546.853,33	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.597.436,27	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	4.518.425,21	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.706.756,54	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.790.892,43	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.466.368,30	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	183.528,77	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	502.315,47	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	29.157,75	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	157.096,81	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.078.822,41	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	2.903.443,37	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.170.420,31	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	32.309,02	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/21	15/09/31	LOCALIZA	2.254.887,25	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	18/06/21	15/12/30	MG050	1.466.830,67	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	1.333.956,23	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	791.594,51	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	287.168,54	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	2.741.056,13	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	635.505,45	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	10/02/21	15/12/31	METRORIO	2.044.599,44	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.333.558,69	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	2.096.053,07	brAA+	-	-
FIM EMB 1A	16/05/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	888.419,23	-	-	AAA(bra)
FIM EMB 1A	16/05/23	23/12/20	15/12/27	SABESP	2.286.219,00	brAAA	-	-
FIM EMB 1A	16/05/23	21/07/21	15/07/31	CACHOEIR	1.627.784,32	brAAA	-	-
FIM EMB 1A	16/05/23	29/10/21	15/10/26	COELBA	1.870.300,90	brAAA	-	-
FIM EMB 1A	16/05/23	04/05/22	15/04/27	LOCALIZA	2.928.102,88	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	53.947,79	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/06/23	25/06/21	20/06/26	OURO VER	288.503,68	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/06/23	23/06/23	15/05/43	IUGA R.J	1.309.772,04	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	999.032,70	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	28/07/22	18/07/25	1V11	373.551,96	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	1.132.738,43	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	276.891,62	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/07/23	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.043.934,02	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	491.703,20	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	791.358,19	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	1.311.411,24	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	01/08/23	31/07/23	25/07/28	TIMSA	2.105.537,91	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	17/04/23	17/03/30	VERO	205.040,17	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	06/12/21	15/12/35	TESC	1.911.805,98	-	-	A+(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2025

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.081.522,68	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	953.552,61	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	05/06/18	05/06/28	BRADESCO	4.418.289,61	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/08/23	08/08/23	15/01/34	SPERIO4	2.334.261,71	brAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	29/08/23	29/08/23	29/08/25	BRADESCO	11.800.255,94	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	30/08/23	30/08/23	01/09/25	VOLKSWAG	7.101.342,74	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/09/23	08/09/23	08/09/25	B VOTORA	7.086.350,68	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	13/09/23	15/09/25	PANAMERI	5.852.962,91	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/09/23	21/09/23	15/09/28	ELETROB	2.678.341,33	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/23	28/09/23	15/09/30	CSMG	2.576.266,70	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	19/05/21	10/05/30	RODO BR	2.598.372,15	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	06/09/21	20/08/31	S LUIZ A	1.538.694,52	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	13/09/23	15/09/25	B VOTORA	5.837.693,36	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/10/23	14/11/22	10/10/31	CORREDOR	2.335.083,09	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/10/23	20/10/23	20/10/28	SANTANDE	4.729.827,09	-	AAA.br	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	23/09/21	15/09/31	LOCALIZA	3.015.857,80	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.587.200,00	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/11/23	18/06/21	15/12/30	MG050	878.746,48	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	29/09/22	15/09/28	VERT5	2.239.854,67	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.027.134,62	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	977.020,79	-	Aa3.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/12/23	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	11.381.506,65	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	DAYCOVAL	11.300.755,68	brAA+	-	AA+(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	B.ALFA	11.292.472,40	-	AAA.br	AA+(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	ABC	11.331.092,72	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	17/04/23	17/03/30	VERO	2.971.968,09	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.100.629,96	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.867.140,12	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	48.952,62	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.745.310,76	brA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	11/01/24	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	11.965.303,69	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	18/01/24	18/01/24	04/01/27	TOYOTA	6.518.831,64	brAAA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	26/01/26	ABC	11.271.967,28	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	25/01/27	BTG PACT	4.833.567,39	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	25/01/24	25/01/24	26/01/26	BTG PACT	7.222.272,43	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.105.854,95	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	989.158,86	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	01/06/23	25/05/26	LM TRANS	2.572.975,91	-	AA+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.332.660,09	-	-	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	31/01/24	31/01/24	02/02/26	B.ALFA	11.880.935,51	-	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/02/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	2.137.213,88	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/02/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	1.832.511,86	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/02/24	12/11/21	30/04/29	HAPVIDA	552.700,90	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	18/03/21	15/02/26	CORSAN	1.334.536,98	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	07/04/21	15/03/26	CAGECE	1.922.112,65	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	24/03/22	11/03/27	ARTERIS	2.592.729,28	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	16/02/24	15/02/34	NTRASSUD	2.778.894,36	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	257.750,53	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	18/06/21	15/12/30	MG050	275.211,81	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	727.466,31	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	805.300,62	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	257.750,53	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	12/02/21	15/12/35	MS 306	301.775,66	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	40.001,30	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	461.919,77	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	10/02/21	15/12/31	METRORIO	461.919,02	brAA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/02/24	26/02/24	01/03/27	BTG PACT	11.869.556,42	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/03/24	05/03/24	24/08/26	B VOTORA	7.248.089,69	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/03/24	23/09/21	15/09/31	LOCALIZA	2.011.290,44	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/03/24	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.161.331,21	brAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/04/24	05/04/24	06/04/26	PSA	7.142.177,71	-	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	16/05/24	16/05/24	18/05/26	BANSICRE	3.587.451,80	brAAA	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/05/24	10/11/21	30/10/31	DASA	1.468.314,52	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/06/24	18/06/24	10/06/29	OURO VER	622.148,88	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/07/24	17/07/24	15/07/34	CSMG	2.881.422,65	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	05/08/24	01/08/24	15/07/27	CEA MODA	1.435.693,14	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/24	01/08/24	11/06/30	VIX LOGI	2.201.056,58	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/08/24	05/06/24	15/05/34	JALLES M	555.290,88	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/08/24	06/08/24	15/03/43	BARUERI	1.209.680,91	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/08/24	09/05/24	15/04/34	ENEVA	192.721,64	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/08/24	30/08/24	15/08/41	ROD TRIA	2.409.006,05	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/10/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	586.299,14	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/10/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	504.126,86	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/11/24	06/11/24	15/10/34	HIGHLINE	2.302.936,53	-	-	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/24	12/08/22	15/12/30	SSIOO	1.808.108,21	-	A-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/24	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	1.490.207,13	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	1.648.242,61	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/24	24/06/24	15/06/34	QGEP	2.111.207,06	brAA-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/12/24	17/12/24	15/12/38	VPORTES A	2.418.640,89	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/12/24	13/11/24	13/11/32	LIGHT	683.946,48	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/12/24	13/11/24	13/11/37	LIGHT	50.570,33	-	-	D



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2025

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/12/24	13/11/24	13/11/32	LIGHT	256.432,33	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/12/24	13/11/24	13/11/37	LIGHT	134.421,98	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/12/24	28/11/24	31/08/27	LIGHT S/	204.877,20	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/01/25	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	959.549,00	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/01/25	06/11/24	15/10/34	HIGHLINE	861.841,31	-	-	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/01/25	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.421.820,11	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/01/25	03/10/24	15/09/41	ATHON GE	583,67	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/01/25	06/11/23	15/10/33	3RPR	1.051,86	brAA-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	622.925,50	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.209.647,35	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	399.697,35	brAA-(sf)	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	377.391,60	-	AAA-br	-

Observação: Em janeiro de 2025, 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 **5.207.523.105,76**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	4.627.418.539,44	5.207.523.105,76	88,86%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	4.020.970.295,74	5.207.523.105,76	77,21%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	606.448.243,70	4.166.018.546,69	11,65%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	1.041.504.636,67	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	520.752.318,34	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.301.880.776,44	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.301.880.776,44	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	475.744.064,91	3.645.266.111,95	9,14%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.301.880.776,44	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	71.904.932,66	1.041.504.636,67	1,38%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	29.783.811,48	781.128.496,90	0,57%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	1.041.504.636,67	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	520.752.318,34	0,00%	Enquadrado

(*) O Relatório Completo de Enquadramentos Legais está disponível no portal da EMBRAER PREV
(www.embraerprev.com.br)

6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE JANEIRO DE 2025 À 31 DE JANEIRO DE 2025



FIM EMB I A												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL	
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		DIF. TX.
06/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Venda	4,4064%	4,2505%	3,7505%	4,8024%	0,1559%	NÃO
06/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Venda	4,4064%	4,2505%	3,7505%	4,8024%	0,1559%	NÃO
09/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Venda	4,2013%	4,2673%	3,5134%	4,5944%	-0,0660%	NÃO
14/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,4495%	7,3993%	7,3085%	7,6241%	0,0502%	NÃO
14/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,4395%	7,3993%	7,3085%	7,6241%	0,0402%	NÃO
14/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,4395%	7,3993%	7,3085%	7,6241%	0,0402%	NÃO
16/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	7,8485%	7,8235%	7,5168%	8,0888%	0,0250%	NÃO
17/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	7,8410%	7,8063%	7,5114%	8,0840%	0,0347%	NÃO
17/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	7,8410%	7,8063%	7,5114%	8,0840%	0,0347%	NÃO
17/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	7,8235%	7,8063%	7,5114%	8,0840%	0,0172%	NÃO
17/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	7,8235%	7,8063%	7,5114%	8,0840%	0,0172%	NÃO
17/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,4105%	7,4885%	7,2768%	7,5921%	-0,0780%	NÃO
21/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,4995%	7,5886%	7,3965%	7,7118%	-0,0891%	NÃO
21/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,5295%	7,5886%	7,3965%	7,7118%	-0,0591%	NÃO
21/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,4995%	7,5886%	7,3965%	7,7118%	-0,0891%	NÃO
21/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,5295%	7,5886%	7,3965%	7,7118%	-0,0591%	NÃO
22/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,5695%	7,5771%	7,4489%	7,7646%	-0,0076%	NÃO
22/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,6095%	7,5771%	7,4489%	7,7646%	0,0324%	NÃO
22/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,5886%	7,5771%	7,4489%	7,7646%	0,0115%	NÃO
24/01/2025	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,6205%	7,5972%	7,4737%	7,7895%	0,0233%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE JANEIRO DE 2025 À 31 DE JANEIRO DE 2025



FIRF EMB II A CRED PRIV												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL	
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		DIF. TX.
06/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/05/2027	Venda	7,7910%	7,6756%	7,5114%	8,1066%	0,1154%	NÃO
06/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2028	Venda	7,9610%	7,8600%	7,7020%	8,2266%	0,1010%	NÃO
06/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/08/2028	Venda	7,9510%	7,8600%	7,7020%	8,2266%	0,0910%	NÃO
06/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Venda	7,9510%	7,8600%	7,7020%	8,2266%	0,0910%	NÃO
06/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,4205%	7,3680%	7,2821%	7,5974%	0,0525%	NÃO
06/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,4205%	7,3680%	7,2821%	7,5974%	0,0525%	NÃO
16/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	7,9054%	7,8235%	7,5168%	8,0888%	0,0819%	NÃO
16/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	7,9054%	7,8235%	7,5168%	8,0888%	0,0819%	NÃO
16/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/05/2029	Compra	7,7301%	7,7500%	7,4882%	7,9542%	-0,0199%	NÃO
20/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	7,8279%	7,8502%	7,4936%	8,0668%	-0,0223%	NÃO
20/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2029	Compra	7,8100%	7,8200%	7,5744%	8,0403%	-0,0100%	NÃO
23/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,7930%	3,7929%	3,2519%	4,3965%	0,0001%	NÃO
23/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,7930%	3,7929%	3,2519%	4,3965%	0,0001%	NÃO
23/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,7930%	3,7929%	3,2519%	4,3965%	0,0001%	NÃO
23/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,7930%	3,7929%	3,2519%	4,3965%	0,0001%	NÃO
23/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,7930%	3,7929%	3,2519%	4,3965%	0,0001%	NÃO
23/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,7930%	3,7929%	3,2519%	4,3965%	0,0001%	NÃO
23/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,7930%	3,7929%	3,2519%	4,3965%	0,0001%	NÃO
23/01/2025	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,7930%	3,7929%	3,2519%	4,3965%	0,0001%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE JANEIRO DE 2025 À 31 DE JANEIRO DE 2025



FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL	
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		DIF. TX.
07/01/2025	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2025	Venda	0,0113%	0,0094%	-0,0407%	0,0516%	0,0019%	NÃO
07/01/2025	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2025	Venda	0,0113%	0,0094%	-0,0407%	0,0516%	0,0019%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE JANEIRO DE 2025 À 31 DE JANEIRO DE 2025



EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA				DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
03/01/2025	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Venda	0,0700%	0,0661%	0,0418%	0,0843%	0,0039%	NÃO
15/01/2025	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Venda	0,0446%	0,0417%	0,0082%	0,0614%	0,0029%	NÃO
23/01/2025	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Venda	0,0416%	0,0422%	0,0037%	0,0577%	-0,0006%	NÃO
24/01/2025	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,2680%	3,2184%	3,0462%	4,1994%	0,0496%	NÃO
24/01/2025	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2026	Compra	7,8561%	7,9071%	7,6558%	8,2312%	-0,0510%	NÃO
24/01/2025	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	XP CCTVM	NTN-B	15/05/2027	Compra	7,7138%	7,7245%	7,5220%	8,1143%	-0,0107%	NÃO
27/01/2025	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Venda	0,0432%	0,0430%	0,0011%	0,0582%	0,0002%	NÃO
28/01/2025	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Venda	0,0431%	0,0417%	0,0018%	0,0572%	0,0014%	NÃO
28/01/2025	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Venda	0,0431%	0,0417%	0,0018%	0,0572%	0,0014%	NÃO
28/01/2025	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Venda	0,0431%	0,0417%	0,0018%	0,0572%	0,0014%	NÃO
28/01/2025	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/05/2029	Compra	7,8695%	7,8444%	7,6527%	8,1189%	0,0251%	NÃO
31/01/2025	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Venda	0,0396%	0,0392%	0,0073%	0,0518%	0,0004%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2025 À 31 DE JANEIRO DE 2025



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	18,08	1.500,00	27.117,46	17,80	18,07	18,20	31.647,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,28	3.400,00	21.366,32	6,00	6,21	6,37	10.919,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	5,46	3.000,00	16.390,00	5,36	5,48	5,61	28.222,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	28,84	1.700,00	49.029,51	28,19	28,81	29,45	14.023,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	28,83	400,00	11.532,05	28,19	28,81	29,45	14.023,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,18	2.600,00	94.062,48	35,89	36,20	36,42	17.042,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	27,09	500,00	13.546,34	26,72	27,13	27,48	16.710,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,16	1.000,00	8.160,43	8,08	8,17	8,27	6.790,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,10	5.900,00	53.682,95	8,93	9,07	9,15	24.713,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,07	6.800,00	61.663,97	8,93	9,07	9,15	24.713,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,10	800,00	27.277,58	33,73	34,07	34,38	34.100,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,09	6.800,00	231.814,94	33,73	34,07	34,38	34.100,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	9,68	14.400,00	139.340,09	9,35	9,68	10,10	37.188,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	9,88	8.300,00	82.004,00	9,35	9,68	10,10	37.188,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ENG11	35,92	600,00	21.554,11	35,48	35,93	36,38	18.924,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	26,92	500,00	13.457,86	26,59	26,84	27,39	32.564,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	11,97	900,00	10.775,00	11,76	11,97	12,13	14.521,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	14,00	2.600,00	36.410,42	13,57	13,94	14,09	8.497,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,19	17.200,00	37.689,01	2,14	2,19	2,24	48.778,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	17,22	1.900,00	32.712,41	17,03	17,20	17,38	8.937,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	8,70	9.900,00	86.092,67	8,63	8,70	8,82	34.489,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	41,09	600,00	24.652,68	40,21	40,95	41,38	28.432,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	17,76	8.700,00	154.542,08	17,39	17,74	17,91	22.712,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	17,75	1.000,00	17.753,48	17,39	17,74	17,91	22.712,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	32,17	4.900,00	157.628,51	31,40	32,04	32,49	30.219,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	32,19	1.200,00	38.623,42	31,40	32,04	32,49	30.219,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,57	700,00	11.599,00	16,43	16,69	16,88	15.338,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,76	700,00	11.729,36	16,43	16,69	16,88	15.338,00
02-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	62,56	500,00	31.278,04	61,35	62,56	63,02	27.850,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	17,89	700,00	12.523,63	17,78	17,95	18,25	17.043,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	6,36	12.600,00	80.166,61	6,16	6,36	6,41	7.420,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,08	2.100,00	75.771,94	35,92	36,07	36,56	18.537,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ6	8,97	1.200,00	10.766,28	8,93	8,98	9,13	22.945,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	33,61	300,00	10.081,84	33,36	33,58	34,07	29.773,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	9,92	2.800,00	27.765,35	9,85	10,01	10,14	44.723,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ENG11	35,47	400,00	14.189,95	35,30	35,64	36,31	13.630,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	14,04	1.300,00	18.250,15	13,91	14,05	14,21	5.116,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,13	44.600,00	94.786,17	2,10	2,13	2,22	42.229,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	17,16	1.100,00	18.876,49	17,07	17,17	17,36	9.021,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	8,54	1.500,00	12.807,45	8,52	8,57	8,71	31.655,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,39	3.800,00	47.093,01	12,26	12,38	12,56	24.484,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,36	8.200,00	101.362,61	12,26	12,38	12,56	24.484,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	36,39	300,00	10.916,00	36,32	36,49	37,04	38.744,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	40,63	300,00	12.189,41	40,38	40,62	41,26	21.884,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	17,64	4.600,00	81.127,57	17,56	17,67	17,92	20.646,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	32,20	500,00	16.101,06	32,02	32,23	32,56	25.274,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	32,18	2.800,00	90.112,97	32,02	32,23	32,56	25.274,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,76	1.100,00	18.432,09	16,57	16,73	16,88	8.524,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	62,66	300,00	18.798,84	62,40	62,80	63,54	24.479,00
03-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	8,07	1.800,00	14.524,09	7,95	8,10	8,58	10.812,00
03-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	40,62	4.418,00	179.441,81	40,38	40,62	41,26	21.884,00
03-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	40,63	861,00	34.978,79	40,38	40,62	41,26	21.884,00
03-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HOFC11	25,00	19.758,00	493.950,00	24,41	25,03	25,99	1.037,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	11,33	3.680,00	41.694,05	11,27	11,36	11,55	36.532,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALOS3	17,88	950,00	16.985,46	17,78	17,95	18,25	17.043,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALPA4	6,41	9.042,00	57.952,92	6,16	6,36	6,41	7.420,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASAI3	5,42	1.030,00	5.592,60	5,33	5,40	5,51	25.699,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AURE3	8,42	2.100,00	17.682,28	8,40	8,43	8,63	8.664,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	3,75	290,00	1.087,14	3,61	3,70	3,82	10.092,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZZA3	28,88	630,00	18.196,10	28,76	29,09	29,92	7.517,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	B3SA3	10,10	1.980,00	19.998,00	10,04	10,12	10,28	38.306,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBAS3	23,74	2.380,00	56.501,20	23,68	23,78	24,06	36.969,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBD3C	10,32	1.240,00	12.796,80	10,26	10,33	10,52	24.899,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBD3C	11,20	4.300,00	48.160,00	11,13	11,22	11,44	36.752,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSE3	35,99	530,00	19.073,65	35,92	36,07	36,56	18.537,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	4,76	290,00	1.380,04	4,71	4,78	4,87	10.061,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	26,72	1.080,00	28.857,80	26,68	26,96	27,34	15.757,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	16,02	210,00	3.364,14	16,00	16,13	16,42	9.776,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAV3	23,20	250,00	5.798,80	22,92	23,18	23,54	14.861,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	24,00	680,00	16.318,72	23,96	24,28	24,78	19.368,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	11,48	220,00	2.524,80	11,38	11,67	12,07	11.748,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CCRO3	10,10	920,00	9.291,92	10,10	10,16	10,28	17.603,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	10,84	1.550,00	16.802,05	10,60	10,74	11,01	43.130,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIN3	4,88	30.740,00	150.011,86	4,88	4,90	5,06	21.219,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	COGN3	1,08	2.110,00	2.278,80	1,07	1,08	1,11	21.274,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	30,99	180,00	5.579,01	30,93	31,07	31,51	5.627,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPLÉ6	8,99	1.410,00	12.675,90	8,93	8,98	9,13	22.945,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CRFB3	5,31	640,00	3.398,80	5,28	5,35	5,57	12.195,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSAN3	8,05	180,00	1.449,00	7,92	8,01	8,10	26.004,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	8,21	190,00	1.559,90	8,16	8,23	8,40	27.023,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CXSE3	14,31	480,00	6.868,80	14,23	14,31	14,50	16.958,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CYRE3	16,43	750,00	12.322,86	16,30	16,45	16,70	9.933,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EGIE3	35,31	240,00	8.473,68	34,79	35,10	35,58	9.363,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	33,55	12.420,00	416.692,26	33,36	33,58	34,07	29.773,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET6	37,31	260,00	9.699,80	37,09	37,31	38,05	7.174,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EMBR3	57,03	620,00	35.358,32	57,03	57,49	58,00	20.461,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	10,07	8.230,00	82.876,10	9,85	10,01	10,14	44.723,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENG11	35,60	270,00	9.612,00	35,30	35,64	36,31	13.630,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQT3	26,24	1.300,00	34.112,02	26,24	26,43	26,91	29.329,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EZTC3	10,59	5.304,00	56.169,24	10,54	10,62	10,90	10.582,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	17,32	1.040,00	18.103,08	17,32	17,47	17,87	29.029,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	2,10	4.000,00	8.400,00	2,10	2,13	2,22	42.229,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2025 À 31 DE JANEIRO DE 2025



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HYPE3	17,92	1.770,00	31.714,56	17,61	17,82	17,92	17.680,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IGT11	17,07	200,00	3.413,82	17,07	17,17	17,36	9.021,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IRBR3	42,05	60,00	2.523,24	42,05	43,00	44,27	6.313,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ISAE4	22,55	360,00	8.118,10	22,55	22,66	23,00	13.017,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	8,53	4.750,00	40.517,76	8,52	8,57	8,71	31.655,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	29,82	22.450,00	669.458,51	29,82	30,10	30,62	44.345,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBSS3	36,33	1.140,00	41.416,20	36,12	36,53	37,05	30.693,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KLBN11	22,67	640,00	14.507,82	22,58	22,82	23,23	17.509,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LREN3	12,15	1.070,00	13.000,50	11,99	12,12	12,31	26.223,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LWSA3	3,23	1.250,00	4.037,25	3,18	3,21	3,27	7.849,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MGLU3	6,26	400,00	2.504,00	6,15	6,31	6,56	19.505,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRFG3	16,85	250,00	4.212,50	16,53	16,92	17,22	29.886,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRVE3	5,12	530,00	2.713,60	5,12	5,19	5,29	10.315,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	20,27	80,00	1.621,88	20,16	20,32	20,60	19.255,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	12,42	800,00	9.934,92	12,26	12,38	12,56	24.484,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PCAR3	2,65	5.030,00	13.329,59	2,61	2,68	2,74	10.630,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETR3	40,38	8.630,00	348.467,00	39,96	40,26	40,72	30.019,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETRA	36,38	3.710,00	134.969,79	36,32	36,49	37,04	38.744,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETZ3	4,02	430,00	1.727,32	3,95	4,01	4,06	7.215,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	POMO4	7,35	36.950,00	271.584,78	7,35	7,40	7,69	18.181,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PRIO3	40,62	380,00	15.435,48	40,38	40,62	41,26	21.884,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PSSA3	34,77	10.120,00	351.919,85	34,77	35,13	36,32	15.309,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	20,80	1.450,00	30.160,00	20,75	21,02	21,87	25.691,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIL3	17,59	1.070,00	18.820,76	17,56	17,67	17,92	20.646,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAI24	2,13	1.670,00	3.556,92	2,08	2,10	2,14	14.815,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	25,15	960,00	24.144,49	24,91	25,12	25,60	21.778,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RECV3	16,43	230,00	3.777,99	16,20	16,40	16,50	9.336,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	32,28	170,00	5.487,24	32,02	32,23	32,56	25.274,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	23,42	330,00	7.728,50	23,22	23,42	23,95	7.697,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBS3	86,91	580,00	50.407,20	86,40	87,17	88,83	17.170,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SLCE3	17,02	160,00	2.723,04	17,02	17,09	17,28	7.452,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SMT03	24,18	630,00	15.236,25	23,10	23,85	24,20	8.272,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	STBP3	13,18	790,00	10.411,00	13,15	13,18	13,25	12.765,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	62,67	520,00	32.590,87	62,40	62,80	63,54	24.479,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TAE11	32,21	200,00	6.442,00	32,21	32,40	33,00	11.022,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	14,42	680,00	9.805,36	14,37	14,42	14,67	18.891,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTSS	26,14	450,00	11.764,92	25,89	26,12	26,46	12.727,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	15,55	920,00	14.306,00	15,50	15,68	15,97	17.826,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	USIM5	4,85	580,00	2.813,30	4,85	4,95	5,16	12.967,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	53,24	3.570,00	190.068,88	52,88	53,36	54,00	58.394,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VAMO3	4,58	540,00	2.473,76	4,53	4,59	4,70	9.405,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBBR3	17,60	870,00	15.312,00	17,59	17,67	17,87	20.488,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVA3	18,10	120,00	2.172,13	18,07	18,24	18,73	12.115,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIVT3	46,86	1.040,00	48.736,36	46,33	46,70	47,49	13.549,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	WEGE3	52,46	370,00	19.409,66	52,26	52,61	53,11	23.008,00
03-01-25	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	YDUQ3	8,04	360,00	2.893,98	7,95	8,10	8,58	10.812,00
06-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	BPAC11	27,27	5.100,00	139.087,20	26,91	27,29	27,55	18.483,00
06-01-25	FIA RVA EMB II	Venda	BRF53	23,80	9.700,00	230.858,40	23,61	23,88	24,33	18.306,00
06-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	CPL6	9,13	14.200,00	129.689,12	8,99	9,09	9,18	16.388,00
06-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	DIRR3	25,49	7.800,00	198.792,72	25,19	25,48	25,71	10.646,00
06-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	12,38	8.200,00	101.507,26	12,25	12,46	12,64	25.771,00
06-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	12,70	21.400,00	271.795,21	12,37	12,60	12,89	19.357,00
06-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	PRIO3	41,69	3.700,00	154.258,54	40,98	41,38	41,95	23.301,00
06-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	RDOR3	25,79	1.900,00	33.522,33	25,31	25,64	26,02	19.420,00
06-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	SBS3	87,73	2.700,00	236.878,94	87,17	87,98	88,95	12.440,00
06-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	5,66	2.900,00	13.015,33	5,59	5,68	5,80	20.039,00
06-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,29	1.700,00	29.387,35	16,80	17,26	17,47	11.058,00
06-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	8,52	6.537,00	55.718,59	8,40	8,49	8,61	9.023,00
06-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	8,43	3.033,00	25.558,84	8,40	8,49	8,61	9.023,00
06-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	20,89	747,00	15.606,90	20,44	20,74	21,00	21.370,00
06-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	20,86	567,00	11.827,07	20,44	20,74	21,00	21.370,00
06-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	20,69	4.324,00	89.453,83	20,44	20,74	21,00	21.370,00
06-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	41,47	3.746,00	155.330,09	40,98	41,38	41,95	23.301,00
06-01-25	FIA EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	NEWL11	100,00	121,00	12.100,36	98,03	99,53	100,50	240,00
07-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	HAPV3	2,30	122.900,00	282.567,81	2,17	2,32	2,38	35.777,00
07-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	LWSA3	3,46	41.200,00	142.646,98	3,34	3,44	3,56	10.760,00
07-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	13,01	27.700,00	360.341,60	12,67	12,99	13,19	23.554,00
07-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	RDOR3	26,65	5.200,00	138.577,52	26,09	26,58	26,82	19.066,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	52,46	15.700,00	823.564,33	51,94	52,32	52,89	46.389,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	5,77	16.000,00	92.300,15	5,65	5,77	5,88	31.107,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	5,71	8.600,00	49.106,00	5,65	5,77	5,88	31.107,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BSE3	36,43	4.200,00	152.999,84	36,19	36,46	36,69	22.383,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,18	4.500,00	153.817,76	33,99	34,17	34,40	20.441,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,65	1.700,00	18.107,48	10,59	10,73	11,00	22.940,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,65	3.500,00	37.269,57	10,59	10,73	11,00	22.940,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,72	15.400,00	165.143,65	10,59	10,73	11,00	22.940,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,36	46.900,00	110.684,00	2,17	2,32	2,38	35.777,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,36	36.800,00	86.895,20	2,17	2,32	2,38	35.777,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	17,22	1.000,00	17.221,88	17,10	17,35	17,64	9.612,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	17,41	400,00	6.964,95	17,10	17,35	17,64	9.612,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,98	5.800,00	75.307,10	12,67	12,99	13,19	23.554,00
07-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	31,87	2.300,00	73.289,67	31,32	31,94	32,61	33.151,00
07-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	8,35	1.630,00	13.602,90	8,31	8,35	8,49	13.384,00
07-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	8,35	7.174,00	59.907,70	8,31	8,35	8,49	13.384,00
07-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	21,03	163,00	3.428,49	20,68	20,90	21,25	22.536,00
07-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	20,94	70,00	1.465,56	20,68	20,90	21,25	22.536,00
07-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	20,73	303,00	6.281,43	20,68	20,90	21,25	22.536,00
07-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	21,01	143,00	3.005,13	20,68	20,90	21,25	22.536,00
08-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	BBAS3	24,17	13.300,00	321.505,89	23,95	24,12	24,27	31.571,00
08-01-25	FIA RVA EMB II	Venda	VBBR3	17,70	19.500,00	345.092,26	17,60	17,76	18,03	20.275,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	17,70	2.300,00	40.710,58	17,62	17,71	18,12	14.350,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	6,46	2.200,00	14.219,99	6,42	6,47	6,66	6.998,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2025 À 31 DE JANEIRO DE 2025



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
08-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	5,60	13.800,00	77.239,30	5,44	5,58	5,73	31.424,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	24,11	900,00	21.697,12	23,95	24,12	24,27	31.571,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,34	3.000,00	109.025,03	36,21	36,33	36,78	14.407,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,26	800,00	29.004,41	36,21	36,33	36,78	14.407,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	27,86	1.800,00	50.150,32	27,66	27,89	28,13	24.364,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	27,89	3.800,00	105.975,33	27,66	27,89	28,13	24.364,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	27,92	1.100,00	30.706,67	27,66	27,89	28,13	24.364,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ3	8,12	4.100,00	33.288,85	8,08	8,14	8,23	4.508,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ6	9,02	3.800,00	34.275,95	8,98	9,04	9,12	14.552,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,16	1.000,00	34.162,41	33,55	34,03	34,35	27.656,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,15	1.700,00	58.047,24	33,55	34,03	34,35	27.656,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,15	200,00	6.830,00	33,55	34,03	34,35	27.656,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,15	2.700,00	92.205,00	33,55	34,03	34,35	27.656,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,57	1.500,00	15.849,96	10,47	10,59	10,69	27.391,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,53	5.600,00	58.968,00	10,47	10,59	10,69	27.391,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	36,84	1.000,00	36.842,45	36,72	36,99	37,48	13.803,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	27,00	2.600,00	70.211,42	26,93	27,12	27,60	28.283,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	12,15	1.200,00	14.576,06	12,05	12,13	12,22	9.092,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	14,50	1.600,00	23.200,00	14,32	14,48	14,78	8.574,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	14,51	2.900,00	42.085,95	14,32	14,48	14,78	8.574,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,33	44.000,00	102.607,79	2,26	2,33	2,41	43.711,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,30	6.800,00	15.661,59	2,26	2,33	2,41	43.711,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	17,05	3.500,00	59.681,51	17,01	17,12	17,32	11.371,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	8,72	4.800,00	41.845,99	8,70	8,75	8,86	28.688,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,87	1.900,00	24.456,56	12,70	12,86	13,02	17.840,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	41,33	1.000,00	41.329,01	41,13	41,37	42,25	34.850,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	18,03	2.000,00	36.069,45	17,83	18,00	18,16	20.656,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	16,17	600,00	9.704,96	16,05	16,20	16,39	7.256,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,57	2.800,00	85.590,97	30,18	30,59	31,77	40.004,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,35	4.500,00	78.057,33	17,23	17,37	17,86	9.175,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,76	2.500,00	154.396,09	61,04	61,78	62,84	24.853,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,73	900,00	55.555,62	61,04	61,78	62,84	24.853,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	51,57	1.000,00	51.567,10	51,43	51,67	52,29	53.183,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	51,70	14.100,00	728.939,74	51,43	51,67	52,29	53.183,00
08-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	VBRB3	17,68	1.200,00	21.220,79	17,60	17,76	18,03	20.275,00
08-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	41,30	3.865,00	159.613,20	41,13	41,37	42,25	34.850,00
08-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	41,23	317,00	13.071,28	41,13	41,37	42,25	34.850,00
08-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	CBOP11	20,84	382,00	7.960,88	20,70	20,97	22,01	403,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	17,79	600,00	10.672,07	17,58	17,75	17,86	7.254,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	5,73	13.100,00	75.116,40	5,53	5,70	5,80	24.375,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	30,68	400,00	12.271,18	30,31	30,75	31,19	5.312,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ6	8,95	1.100,00	9.846,61	8,92	8,95	9,02	19.212,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,36	3.600,00	123.678,34	33,98	34,39	34,51	14.802,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,67	3.300,00	35.205,70	10,50	10,66	10,80	16.218,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	36,82	300,00	11.045,64	36,53	36,81	37,10	8.744,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	27,30	4.200,00	114.668,59	27,01	27,32	27,54	22.668,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,31	4.200,00	9.707,27	2,26	2,31	2,37	18.009,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	17,08	1.000,00	17.083,54	16,94	17,08	17,20	9.321,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	8,76	1.400,00	12.261,93	8,68	8,76	8,82	24.086,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,72	300,00	3.816,00	12,67	12,78	12,97	10.973,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,81	3.700,00	47.393,09	12,67	12,78	12,97	10.973,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,95	3.300,00	59.235,00	17,82	17,91	18,04	25.898,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,95	4.100,00	73.595,00	17,82	17,91	18,04	25.898,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,92	9.700,00	173.808,10	17,82	17,91	18,04	25.898,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,91	800,00	14.331,27	17,82	17,91	18,04	25.898,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,61	1.800,00	55.090,56	30,28	30,48	30,84	18.726,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,55	200,00	3.509,54	17,26	17,57	17,76	8.915,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,58	300,00	18.473,34	61,20	61,62	62,29	14.668,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,65	3.700,00	228.095,27	61,20	61,62	62,29	14.668,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	51,77	11.900,00	616.008,37	51,14	51,66	52,25	37.549,00
09-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	9,04	1.200,00	10.846,06	8,82	9,02	9,15	9.209,00
09-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	8,14	4.097,00	33.342,15	8,00	8,07	8,19	7.466,00
09-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	8,09	836,00	6.759,36	8,00	8,07	8,19	7.466,00
09-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	8,01	819,00	6.557,05	8,00	8,07	8,19	7.466,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	17,43	100,00	1.742,90	17,41	17,49	17,80	13.359,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	17,49	4.400,00	76.974,01	17,41	17,49	17,80	13.359,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	5,58	16.500,00	92.090,85	5,48	5,58	5,69	22.422,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,59	3.600,00	131.729,86	36,13	36,44	37,04	13.597,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,58	1.700,00	17.982,05	10,43	10,61	10,77	19.539,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,60	2.000,00	21.207,52	10,43	10,61	10,77	19.539,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,61	8.500,00	90.150,00	10,43	10,61	10,77	19.539,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	14,33	2.100,00	30.085,05	14,13	14,29	14,59	7.536,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,24	12.000,00	26.843,63	2,18	2,21	2,26	35.079,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	16,80	700,00	11.760,75	16,77	16,92	17,19	8.574,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	16,89	3.600,00	60.792,98	16,77	16,92	17,19	8.574,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	43,05	5.300,00	228.151,29	42,46	43,05	43,71	47.109,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,32	10.600,00	183.569,09	17,18	17,32	17,85	36.110,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	29,28	7.400,00	216.657,53	28,70	29,25	30,70	32.755,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,41	800,00	13.927,49	17,27	17,53	17,83	7.969,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,21	1.500,00	91.816,91	60,54	61,19	61,89	15.988,00
10-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	51,66	2.400,00	123.986,56	51,23	51,70	52,31	46.317,00
10-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	7,88	3.930,00	30.953,87	7,82	7,86	8,07	13.939,00
10-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	7,85	3.419,00	26.850,15	7,82	7,86	8,07	13.939,00
10-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	42,80	1.653,00	70.748,58	42,46	43,05	43,71	47.109,00
10-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	42,69	2.342,00	99.972,17	42,46	43,05	43,71	47.109,00
10-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	CBOP11	20,84	206,00	4.293,04	20,84	20,84	21,20	19,00
10-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	FIGS11	45,00	773,00	34.788,19	44,50	45,21	46,08	121,00
10-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	OULG11	31,91	33.904,00	1.081.876,64	31,90	31,91	32,42	15,00
10-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PATC11	35,15	69.540,00	2.444.331,00	35,00	35,15	35,58	64,00
10-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	QAGR11	42,42	70.600,00	2.994.852,00	42,12	42,41	42,75	217,00
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	17,28	500,00	8.639,34	17,16	17,24	17,52	11.420,00
13-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	5,57	12.000,00	66.860,74	5,49	5,54	5,65	26.022,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2025 À 31 DE JANEIRO DE 2025



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA				VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO		
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	29,29	500,00	14.646,15	28,97	29,40	30,11	8.417,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	24,26	500,00	12.128,45	24,16	24,27	24,43	24.659,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	28,48	600,00	17.086,02	28,15	28,44	28,71	20.906,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	28,49	2.600,00	74.081,00	28,15	28,44	28,71	20.906,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	7,95	2.400,00	19.088,33	7,89	7,95	8,05	4.439,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	8,85	2.100,00	18.579,90	8,73	8,85	8,92	20.423,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	33,87	600,00	20.324,25	33,79	33,92	34,16	16.315,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,07	1.300,00	14.388,74	10,67	11,00	11,21	18.829,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	36,40	600,00	21.838,61	36,24	36,44	36,91	11.165,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	27,01	3.000,00	81.026,25	26,87	27,07	27,33	27.521,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	11,63	800,00	9.305,74	11,54	11,65	11,90	13.245,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	13,95	900,00	12.556,36	13,80	13,91	14,15	5.290,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,17	8.800,00	19.061,81	2,15	2,16	2,23	55.393,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	16,73	700,00	11.711,38	16,63	16,71	16,92	8.532,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	8,73	14.600,00	127.519,38	8,63	8,72	8,78	22.139,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,31	6.100,00	75.086,49	12,07	12,28	12,64	20.388,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,29	1.200,00	14.746,54	12,07	12,28	12,64	20.388,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	42,68	700,00	29.873,65	42,50	42,66	43,54	28.414,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,18	8.900,00	152.944,39	17,01	17,18	17,41	25.887,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,25	4.100,00	70.725,48	17,01	17,18	17,41	25.887,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,16	1.400,00	24.021,09	17,01	17,18	17,41	25.887,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	28,90	6.900,00	199.420,04	28,31	28,82	29,33	27.140,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	17,39	1.300,00	22.600,99	17,28	17,39	17,55	8.128,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	62,16	400,00	24.863,72	61,29	62,12	62,70	18.198,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	51,65	3.200,00	165.287,80	50,87	51,59	52,31	52.360,00	
13-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	VBR3	17,45	1.000,00	17.452,24	17,34	17,48	17,63	21.836,00	
13-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	7,85	340,00	2.668,57	7,77	7,86	7,94	8.713,00	
13-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	7,89	9.606,00	75.791,34	7,77	7,86	7,94	8.713,00	
13-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	7,83	198,00	1.549,59	7,77	7,86	7,94	8.713,00	
13-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	7,84	15,00	117,53	7,77	7,86	7,94	8.713,00	
13-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	42,81	1.130,00	48.376,10	42,50	42,66	43,54	28.414,00	
13-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	42,74	1.549,00	66.199,94	42,50	42,66	43,54	28.414,00	
13-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	42,63	1.270,00	54.135,00	42,50	42,66	43,54	28.414,00	
13-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BRCR11	39,63	11.500,00	441.874,50	39,55	39,75	40,50	6.465,00	
13-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HSRE11	101,46	16.603,00	1.684.482,78	93,02	101,44	102,50	23,00	
13-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	62,34	9.504,00	592.523,64	61,28	62,34	62,47	68,00	
13-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	35,26	19.448,00	685.784,72	35,22	35,26	35,88	44,00	
13-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PQDP11	2.010,00	239,00	480.390,00	2.005,00	2.011,41	2.068,98	25,00	
13-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	3,65	109.753,00	400.598,45	3,60	3,65	3,67	750,00	
13-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	3,66	163.471,00	598.303,86	3,60	3,65	3,67	750,00	
13-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	VVMR11	82,00	169,00	13.858,00	82,00	86,30	87,49	36,00	
13-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	VVMR11	86,36	24.629,00	2.126.906,69	82,00	86,30	87,49	36,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	6,11	2.200,00	13.439,00	6,07	6,12	6,25	5.594,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	5,38	10.000,00	53.789,61	5,29	5,38	5,56	25.783,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	30,27	400,00	12.107,00	29,41	30,15	30,43	7.651,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	28,38	400,00	11.353,00	28,11	28,42	28,68	18.267,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	7,99	1.400,00	11.181,00	7,87	7,92	8,02	2.099,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	8,85	1.800,00	15.933,00	8,73	8,82	8,88	10.071,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	33,99	400,00	13.597,00	33,70	33,98	34,15	18.350,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	10,80	900,00	9.718,00	10,73	10,83	11,11	14.840,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	36,21	400,00	14.482,16	35,87	36,22	36,48	12.056,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	27,02	7.100,00	191.842,00	26,82	27,06	27,27	26.483,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	27,04	1.800,00	48.670,41	26,82	27,06	27,27	26.483,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,18	5.200,00	11.343,20	2,14	2,17	2,20	30.227,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,18	34.600,00	75.346,71	2,14	2,17	2,20	30.227,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	17,15	1.100,00	18.860,00	16,61	17,07	17,27	9.598,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	8,69	4.600,00	39.996,61	8,62	8,69	8,76	17.468,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,33	900,00	11.093,00	11,89	12,28	12,44	17.778,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	42,24	400,00	16.896,00	42,09	42,27	42,58	23.091,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,25	1.200,00	20.704,00	16,96	17,19	17,46	23.266,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,22	7.800,00	134.324,67	16,96	17,19	17,46	23.266,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	29,25	3.600,00	105.303,18	28,76	29,24	29,64	26.590,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	17,68	1.300,00	22.986,00	17,17	17,64	17,84	9.050,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,25	400,00	24.498,00	60,82	61,35	62,44	18.388,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	51,97	1.100,00	57.170,59	51,63	51,99	52,43	37.129,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	VBR3	17,37	600,00	10.422,00	17,25	17,40	17,59	18.375,00	
14-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,48	1.400,00	11.865,00	8,36	8,51	8,74	9.304,00	
14-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	7,75	2.219,00	17.200,23	7,71	7,78	7,85	8.429,00	
14-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	7,77	3.315,00	25.773,41	7,71	7,78	7,85	8.429,00	
14-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	20,36	4.315,00	87.836,08	19,94	20,37	20,60	19.709,00	
14-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	20,40	3.984,00	81.269,96	19,94	20,37	20,60	19.709,00	
14-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	FMOF11	36,10	179,00	6.461,90	36,03	36,10	36,40	12,00	
14-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	35,25	22.669,00	799.112,10	35,12	35,25	35,98	46,00	
15-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	11,41	9.800,00	111.818,00	11,16	11,29	11,43	42.213,00	
15-01-25	FIA RVA EMB II	Venda	EQT3	1,92	251,00	481,07	1,01	2,06	2,57	289,00	
15-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	IGTI11	17,58	20.500,00	360.484,91	17,35	17,60	17,81	9.353,00	
15-01-25	FIA RVA EMB II	Venda	MRF3	16,32	19.200,00	313.344,00	16,20	16,36	16,77	20.321,00	
15-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	TIMS3	14,53	20.400,00	296.412,00	14,11	14,31	14,56	19.945,00	
15-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,06	6.900,00	207.418,96	28,75	29,70	30,52	31.925,00	
15-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	36,73	1.600,00	58.769,35	36,41	36,83	37,45	24.548,00	
15-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	27,61	2.700,00	74.547,65	27,32	27,66	28,03	50.155,00	
15-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	13,98	3.200,00	44.736,50	13,66	14,00	14,29	11.572,00	
15-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,40	95.400,00	229.272,52	2,23	2,38	2,44	26.262,00	
15-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,37	90.700,00	215.128,33	2,23	2,38	2,44	26.262,00	
15-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,94	6.000,00	77.636,47	12,43	12,78	13,04	27.157,00	
15-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,83	4.500,00	57.717,04	12,43	12,78	13,04	27.157,00	
15-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,19	4.300,00	73.932,83	16,81	17,21	17,47	45.182,00	
15-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	30,92	1.700,00	52.559,73	29,47	30,42	31,25	40.425,00	
15-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	18,52	1.000,00	18.517,73	17,75	18,33	18,60	14.211,00	
15-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	CPUR11	10,43	572.547,00	5.971.665,21	10,37	10,42	10,44	16,00	
15-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	LASC11	114,20	52.300,00	5.972.660,00	114,20	114,20	114,21	5,00	
16-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	IGTI11	17,42	10.300,00	179.434,97	17,16	17,30	17,71	10.809,00	

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2025 À 31 DE JANEIRO DE 2025



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
16-01-25	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	12,77	10.800,00	137.913,40	12,35	12,52	13,14	26.932,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	18,00	1.100,00	19.795,34	17,90	18,01	18,38	13.551,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	5,57	1.800,00	10.033,75	5,48	5,59	5,72	15.706,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	30,54	500,00	15.270,79	30,26	30,62	31,39	5.699,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,08	4.900,00	147.379,53	29,89	30,07	30,25	26.414,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,12	1.700,00	13.797,92	8,04	8,11	8,25	5.641,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,00	2.200,00	19.799,09	8,92	9,01	9,16	14.415,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,62	3.500,00	121.154,87	34,23	34,58	35,24	15.452,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,52	3.000,00	103.558,12	34,23	34,58	35,24	15.452,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,86	1.200,00	13.027,93	10,77	10,85	11,03	14.304,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,85	2.800,00	30.387,75	10,77	10,85	11,03	14.304,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,91	5.700,00	62.187,00	10,77	10,85	11,03	14.304,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	36,28	1.100,00	39.908,00	35,69	36,26	37,08	18.530,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	36,16	1.400,00	50.625,96	35,69	36,26	37,08	18.530,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	36,20	600,00	21.718,97	35,69	36,26	37,08	18.530,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	27,54	1.500,00	41.304,06	27,35	27,56	27,82	25.511,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	13,62	1.500,00	20.428,00	13,52	13,69	14,21	8.604,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	13,67	1.900,00	25.973,00	13,52	13,69	14,21	8.604,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,37	9.200,00	21.829,18	2,33	2,36	2,41	58.114,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	17,29	2.900,00	50.144,04	17,16	17,30	17,71	10.809,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,03	2.900,00	26.185,65	8,98	9,03	9,11	32.313,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,61	1.200,00	15.133,30	12,50	12,62	13,09	13.187,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	41,91	500,00	20.954,34	41,17	42,03	42,83	29.119,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	17,09	1.600,00	27.339,03	16,84	17,11	17,65	43.829,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,19	1.700,00	51.316,67	29,99	30,22	30,69	19.268,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,99	1.500,00	26.991,04	17,92	18,03	18,44	9.480,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	60,13	500,00	30.064,20	59,74	60,26	61,48	22.910,00
16-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	YBR3	17,26	700,00	12.078,61	17,11	17,30	17,90	15.074,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	BRFS3	23,13	15.900,00	367.740,75	22,32	22,89	23,24	16.211,00
17-01-25	FIA RVA EMB II	Venda	GGBR4	17,39	48.500,00	843.229,23	17,17	17,34	17,50	26.597,00
17-01-25	FIA RVA EMB II	Venda	MRF3	17,18	36.000,00	618.480,00	14,99	15,36	15,62	19.307,00
17-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	54,09	22.700,00	1.227.928,37	52,98	54,08	54,49	65.490,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	17,94	3.400,00	61.008,81	17,66	17,93	18,06	7.772,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	17,97	1.200,00	21.564,00	17,66	17,93	18,06	7.772,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,97	2.500,00	87.421,82	34,22	35,05	35,49	16.998,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,13	900,00	31.617,33	34,22	35,05	35,49	16.998,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,96	2.300,00	80.406,54	34,22	35,05	35,49	16.998,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,55	800,00	27.643,73	34,22	35,05	35,49	16.998,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	36,65	1.200,00	43.980,00	35,79	36,48	37,00	23.747,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	36,25	3.500,00	126.878,40	35,79	36,48	37,00	23.747,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	36,30	800,00	29.040,00	35,79	36,48	37,00	23.747,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	36,82	800,00	29.455,41	35,79	36,48	37,00	23.747,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,25	26.500,00	59.743,81	2,24	2,30	2,38	32.038,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	17,14	2.200,00	37.708,58	17,00	17,14	17,34	8.368,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	17,12	2.700,00	46.235,99	17,00	17,14	17,34	8.368,00
17-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,80	2.300,00	29.440,12	12,29	12,54	12,84	11.449,00
17-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ3	8,29	4.375,00	36.283,64	8,08	8,29	8,37	6.170,00
17-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ3	8,33	2.998,00	21.632,68	8,08	8,29	8,37	6.170,00
17-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ6	9,17	3.210,00	29.448,79	8,96	9,18	9,31	15.495,00
17-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ6	9,16	1.772,00	16.231,40	8,96	9,18	9,31	15.495,00
17-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ6	9,27	7.726,00	71.598,74	8,96	9,18	9,31	15.495,00
17-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	17,07	1.252,00	21.371,64	16,94	17,12	17,29	21.354,00
17-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	17,12	1.629,00	27.896,55	16,94	17,12	17,29	21.354,00
17-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	17,07	1.140,00	19.456,99	16,94	17,12	17,29	21.354,00
17-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	17,14	253,00	4.335,43	16,94	17,12	17,29	21.354,00
17-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	SBS3	93,09	1.913,00	178.077,43	90,62	92,71	93,55	22.100,00
17-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	CBOP11	21,01	51,00	1.071,51	21,01	21,05	22,27	14,00
20-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	17,97	1.500,00	26.959,63	17,72	18,00	18,12	9.593,00
20-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	6,07	15.200,00	92.293,28	5,67	6,02	6,21	12.223,00
20-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,01	4.400,00	154.040,03	34,49	35,02	35,27	13.493,00
20-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	37,01	1.200,00	44.414,64	36,11	37,17	37,54	9.083,00
20-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	27,96	3.800,00	106.248,93	27,42	27,94	28,17	14.204,00
20-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	13,65	2.200,00	30.021,04	13,55	13,77	14,03	8.542,00
20-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,25	6.500,00	14.633,50	2,19	2,28	2,33	40.826,00
20-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	17,22	1.700,00	29.268,21	16,91	17,20	17,40	6.666,00
20-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	37,28	3.300,00	123.030,38	37,11	37,27	37,43	32.827,00
20-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	42,91	2.800,00	120.142,82	42,58	42,87	43,17	16.197,00
20-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	30,57	3.000,00	91.705,97	29,85	30,60	31,00	14.966,00
20-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	30,55	2.100,00	64.148,70	29,85	30,60	31,00	14.966,00
20-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	16,95	2.526,00	42.826,58	16,76	16,96	17,17	13.704,00
20-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	16,95	2.633,00	44.629,35	16,76	16,96	17,17	13.704,00
20-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	CBOP11	21,26	151,00	3.210,48	21,26	21,28	21,50	9,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	18,08	1.600,00	28.930,87	17,94	18,08	18,21	6.274,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,25	2.000,00	12.506,12	6,12	6,24	6,31	4.420,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	6,15	7.600,00	46.715,30	6,00	6,14	6,29	20.695,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	6,16	3.000,00	18.480,00	6,00	6,14	6,29	20.695,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	31,46	600,00	18.874,27	30,92	31,47	31,76	7.745,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	25,69	400,00	10.274,00	25,45	25,63	25,75	24.494,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,49	1.600,00	48.776,35	30,16	30,40	30,62	15.923,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,43	2.000,00	60.862,22	30,16	30,40	30,62	15.923,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,36	1.800,00	15.051,56	8,23	8,34	8,37	2.217,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,24	2.300,00	21.262,25	9,08	9,22	9,26	10.304,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,22	2.600,00	91.563,34	34,91	35,23	35,48	17.643,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,91	1.200,00	13.093,10	10,68	10,85	10,95	20.301,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	37,02	1.800,00	66.644,03	36,87	37,01	37,35	10.029,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	36,99	800,00	29.589,60	36,87	37,01	37,35	10.029,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	28,30	1.900,00	53.779,32	27,96	28,28	28,43	24.983,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	28,28	2.200,00	62.223,45	27,96	28,28	28,43	24.983,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	13,69	1.200,00	16.427,21	13,50	13,80	14,00	9.561,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,31	10.200,00	23.593,79	2,24	2,28	2,32	37.366,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	17,33	2.400,00	41.595,06	17,12	17,31	17,48	6.915,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	17,33	2.400,00	41.587,97	17,12	17,31	17,48	6.915,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2025 À 31 DE JANEIRO DE 2025



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,18	2.900,00	26.619,36	9,10	9,16	9,21	20.127,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,52	1.100,00	13.771,55	12,33	12,50	12,69	15.632,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	37,07	2.800,00	103.796,16	36,72	37,06	37,35	34.558,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	42,54	2.200,00	93.597,67	41,98	42,54	42,86	17.988,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	16,90	1.500,00	25.350,88	16,81	16,91	17,06	23.636,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	30,41	2.600,00	79.059,10	30,20	30,41	30,86	16.388,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,43	1.600,00	29.482,54	17,94	18,20	18,54	7.288,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	62,36	500,00	31.180,39	61,65	62,28	62,60	15.453,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	17,59	800,00	14.068,30	17,17	17,60	17,79	22.490,00
21-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	8,89	1.600,00	14.223,82	8,77	8,88	8,98	9.177,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	BRFS3	22,02	13.400,00	295.063,21	21,62	22,04	22,65	25.074,00
22-01-25	FIA RVA EMB II	Venda	CMIG4	10,54	22.400,00	236.072,28	10,48	10,54	10,67	19.648,00
22-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	LWSA3	3,35	52.400,00	175.388,75	3,14	3,29	3,39	14.533,00
22-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	RDOR3	27,75	8.300,00	230.315,18	27,15	27,62	27,88	15.516,00
22-01-25	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	53,00	3.700,00	196.091,48	52,42	53,22	54,29	65.986,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	18,19	3.700,00	67.319,44	17,91	18,22	18,45	11.476,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	18,12	1.300,00	23.556,74	17,91	18,22	18,45	11.476,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ASA3	6,36	17.400,00	110.651,78	6,02	6,25	6,42	19.899,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ASA3	6,38	5.000,00	31.900,00	6,02	6,25	6,42	19.899,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	32,04	2.200,00	70.481,43	30,84	31,94	32,69	15.410,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,83	1.700,00	52.411,00	30,07	30,75	31,12	27.663,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,91	3.300,00	101.986,84	30,07	30,75	31,12	27.663,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,34	2.200,00	77.738,13	35,12	35,28	35,50	16.406,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	37,12	700,00	25.982,99	36,71	37,36	37,77	14.262,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	28,60	2.000,00	57.209,33	28,15	28,71	29,05	36.462,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	17,42	1.500,00	26.132,19	17,25	17,49	17,70	9.202,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	17,37	4.000,00	69.468,69	17,25	17,49	17,70	9.202,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	16,77	4.900,00	82.158,85	16,58	16,81	17,05	27.512,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	18,86	700,00	13.204,51	18,29	18,85	19,11	11.616,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	18,88	2.500,00	47.200,00	18,29	18,85	19,11	11.616,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	18,93	1.700,00	32.181,00	18,29	18,85	19,11	11.616,00
22-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	18,78	3.300,00	61.970,52	18,29	18,85	19,11	11.616,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	18,09	2.100,00	37.997,67	17,98	18,15	18,46	9.210,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ASA3	6,23	1.700,00	10.597,55	6,12	6,28	6,41	19.753,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	32,01	6.300,00	201.688,18	31,43	31,98	32,84	8.181,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,78	3.600,00	96.399,05	26,24	26,79	27,07	57.276,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,20	800,00	24.960,00	30,81	31,08	31,35	33.156,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,14	3.000,00	93.422,17	30,81	31,08	31,35	33.156,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3E	8,27	1.800,00	14.879,91	8,18	8,28	8,50	5.929,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6E	9,13	4.900,00	44.747,84	9,06	9,15	9,39	24.713,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6E	9,19	2.600,00	23.882,25	9,06	9,15	9,39	24.713,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6E	9,07	1.700,00	15.419,00	9,06	9,15	9,39	24.713,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,96	1.400,00	48.943,97	34,77	34,98	35,35	13.370,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,86	1.200,00	13.032,98	10,80	10,87	11,15	13.397,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	36,94	800,00	29.554,89	36,75	37,07	37,71	9.963,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	37,00	700,00	25.899,08	36,75	37,07	37,71	9.963,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	28,46	500,00	14.227,96	28,28	28,49	28,85	14.814,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	28,44	2.200,00	62.570,14	28,28	28,49	28,85	14.814,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	11,55	1.200,00	13.858,00	11,44	11,58	11,87	8.963,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	14,17	1.200,00	17.008,00	14,08	14,22	14,41	6.839,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,35	17.300,00	40.646,16	2,27	2,31	2,38	55.772,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	17,25	3.800,00	65.567,90	17,16	17,33	17,74	7.050,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	17,28	2.100,00	36.293,12	17,16	17,33	17,74	7.050,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,20	3.000,00	27.602,62	9,16	9,22	9,33	23.911,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,19	10.100,00	92.838,49	9,16	9,22	9,33	23.911,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,20	3.800,00	46.346,73	12,08	12,31	12,84	17.440,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,24	1.200,00	14.695,33	12,08	12,31	12,84	17.440,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	41,23	400,00	16.490,71	40,95	41,61	42,69	28.626,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	16,95	3.300,00	55.927,05	16,89	16,89	17,18	22.143,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	16,75	1.100,00	18.425,00	16,89	16,89	17,18	22.143,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	17,02	1.800,00	30.638,00	16,89	16,89	17,18	22.143,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,22	1.000,00	30.217,49	29,89	30,32	30,97	24.635,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	18,82	100,00	1.881,90	18,56	18,74	18,99	7.420,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	18,87	1.600,00	30.198,53	18,56	18,74	18,99	7.420,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	62,45	500,00	31.226,72	61,29	62,47	63,06	19.885,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	52,29	300,00	15.686,79	51,84	52,27	52,99	41.999,00
23-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	17,81	700,00	12.467,75	17,64	17,86	18,14	16.074,00
24-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ASA3	6,37	5.100,00	32.499,35	6,13	6,24	6,46	10.016,00
24-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	26,63	700,00	18.641,00	26,51	26,65	26,85	25.340,00
24-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6E	9,20	2.900,00	26.685,10	9,11	9,19	9,28	13.756,00
24-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	17,10	900,00	15.388,89	16,97	17,11	17,29	7.393,00
24-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	16,76	1.900,00	31.836,49	16,67	16,83	17,09	15.623,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,30	2.800,00	17.637,68	6,10	6,29	6,35	4.776,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ASA3	6,65	18.700,00	124.356,13	6,12	6,61	6,82	36.705,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ASA3	6,66	24.400,00	162.587,65	6,12	6,61	6,82	36.705,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	33,00	2.100,00	69.306,37	31,55	33,01	33,33	11.177,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	27,52	600,00	16.514,00	26,55	27,38	27,71	37.550,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,55	900,00	28.393,81	30,92	31,46	31,67	24.730,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3E	8,47	3.200,00	27.113,33	8,27	8,47	8,55	7.812,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6E	9,39	3.700,00	34.727,04	9,17	9,38	9,45	17.954,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,96	700,00	25.174,15	34,84	35,70	36,17	24.669,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,29	2.200,00	24.836,44	10,77	11,23	11,37	13.385,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	38,48	1.300,00	50.023,16	37,23	38,47	38,82	14.616,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	29,19	3.300,00	96.328,57	28,34	29,15	29,38	26.056,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	11,98	1.100,00	13.177,11	11,54	11,94	12,08	10.980,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	14,70	1.000,00	14.700,82	14,19	14,59	14,80	10.519,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,38	9.800,00	23.299,78	2,28	2,36	2,41	40.882,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	17,69	1.600,00	28.300,11	16,93	17,71	17,95	11.039,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	17,86	4.500,00	80.358,91	16,93	17,71	17,95	11.039,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,30	9.800,00	91.140,21	9,12	9,30	9,38	32.307,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,18	1.900,00	23.141,08	12,02	12,22	12,44	18.462,00
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	37,16	300,00	11.147,14	36,47	37,03	37,30	43.025,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2025 À 31 DE JANEIRO DE 2025



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA				VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO		
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	42,13	1.000,00	42.133,37	40,80	41,48	42,26	32.150,00	
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	17,21	5.600,00	96.373,00	16,63	17,17	17,46	36.009,00	
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	17,34	2.600,00	45.083,00	16,63	17,17	17,46	36.009,00	
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	16,87	1.800,00	30.366,00	16,63	17,17	17,46	36.009,00	
27-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	31,55	6.100,00	192.440,57	30,09	31,43	31,88	30.321,00	
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	19,24	2.900,00	55.810,04	18,57	19,24	19,44	11.295,00	
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	63,18	900,00	56.857,60	62,35	63,06	63,40	20.998,00	
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	53,82	300,00	16.147,46	52,57	53,58	53,98	53.601,00	
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	18,20	1.400,00	25.485,33	17,49	18,15	18,39	21.558,00	
27-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,49	2.200,00	20.869,57	8,84	9,35	9,56	12.176,00	
27-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	42,13	2.124,00	89.473,73	40,80	41,48	42,26	32.150,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMCL11	97,92	90,00	8.812,80	95,90	97,70	97,92	8,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	72,48	480,00	34.789,13	70,00	71,01	72,50	682,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	CEOC11	38,00	200,00	7.600,00	37,83	38,12	39,17	53,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	GARE11	7,95	75.008,00	596.060,52	7,85	7,92	7,99	50.230,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GZIT11	38,80	3.164,00	122.763,20	38,51	38,99	40,44	991,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MALL11	92,41	139,00	12.844,99	92,07	92,38	93,34	1.979,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	58,30	122,00	7.112,60	58,30	58,50	59,39	65,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	93,89	17,00	1.596,07	92,15	92,74	94,21	93,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	34,51	8.693,00	299.999,49	34,00	34,51	34,61	36,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	35,40	526,00	18.620,27	35,00	35,27	35,59	65,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBRP11	45,78	3.690,00	168.929,55	45,28	46,01	46,79	4.320,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	3,59	2.377,00	8.542,10	3,58	3,60	3,65	2.387,00	
27-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPRR11	12,48	1.514,00	18.894,72	12,48	12,49	12,63	655,00	
28-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	AZZA3	33,37	14.000,00	467.193,00	32,79	33,52	33,84	9.221,00	
28-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	CPFE3	33,61	4.200,00	141.153,00	33,51	33,91	34,16	4.250,00	
28-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	MRFEG3	16,00	9.800,00	156.777,00	15,74	15,91	16,09	8.860,00	
28-01-25	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	53,37	8.300,00	443.004,81	52,54	52,93	53,78	50.830,00	
28-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,48	3.500,00	96.175,01	27,32	27,49	27,70	31.785,00	
28-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,06	7.100,00	128.253,78	17,59	17,92	18,37	18.978,00	
28-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,40	31.368,00	75.270,98	2,31	2,38	2,47	40.128,00	
28-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,44	5.815,00	14.188,60	2,31	2,38	2,47	40.128,00	
28-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMCL11	97,92	439,00	42.986,88	94,51	97,84	97,92	5,00	
28-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	71,42	1.542,00	110.127,42	70,21	72,01	72,69	1.794,00	
28-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	GARE11	7,93	9.991,00	76.069,73	7,85	7,88	7,95	51.001,00	
28-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	34,50	1.670,00	57.615,00	34,50	34,50	34,96	304,00	
28-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	35,64	757,00	26.981,11	35,59	35,64	35,80	12,00	
28-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBRP11	45,40	800,00	36.320,00	45,01	45,45	45,80	1.748,00	
29-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,42	5.900,00	161.802,95	27,35	27,47	27,75	31.458,00	
29-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,91	1.800,00	32.238,00	17,63	17,79	17,91	21.370,00	
29-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,35	1.300,00	39.455,00	30,01	30,45	31,65	33.765,00	
29-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,40	4.000,00	121.611,66	30,01	30,45	31,65	33.765,00	
29-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	17,39	9.200,00	159.942,32	17,25	17,36	17,78	38.400,00	
29-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	40,65	16,00	650,40	40,34	40,90	41,59	26.948,00	
29-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	40,65	1.579,00	64.183,48	40,34	40,90	41,59	26.948,00	
30-01-25	FIA RVA EMB II	Compra	EQTL3	30,06	5.400,00	162.301,00	29,09	30,25	30,65	37.625,00	
30-01-25	FIA RVA EMB II	Venda	RADL3	21,72	13.100,00	284.547,66	21,40	21,77	22,05	19.183,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	19,29	4.100,00	79.070,78	18,68	19,20	19,39	17.730,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ASA3	6,79	8.900,00	60.425,94	6,50	6,75	6,92	23.476,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	34,48	800,00	27.584,00	33,57	34,57	35,16	13.259,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	34,66	1.800,00	62.387,29	33,57	34,57	35,16	13.259,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	27,84	600,00	16.701,98	27,28	27,70	27,94	43.933,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	32,01	700,00	22.403,50	31,27	31,87	32,18	23.617,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,81	3.900,00	34.348,97	8,56	8,79	8,89	5.988,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,83	5.200,00	51.128,85	9,51	9,77	9,89	17.580,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,48	900,00	32.836,07	35,38	36,31	36,64	27.999,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENFV3	11,71	2.800,00	32.784,11	11,20	11,66	11,82	16.332,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	40,30	600,00	24.180,00	38,25	39,81	40,44	17.287,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	40,14	600,00	24.085,26	38,25	39,81	40,44	17.287,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	30,45	800,00	24.359,63	29,09	30,25	30,65	37.625,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	30,30	500,00	15.150,00	29,09	30,25	30,65	37.625,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	30,50	800,00	24.401,36	29,09	30,25	30,65	37.625,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	11,97	1.400,00	16.758,70	11,50	11,92	12,10	11.616,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	12,01	1.500,00	18.009,25	11,50	11,92	12,10	11.616,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	15,14	1.300,00	19.680,77	14,48	15,03	15,21	11.409,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,41	41.200,00	99.468,45	2,27	2,37	2,46	27.128,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NGTI11	18,38	4.800,00	88.231,98	17,72	18,30	18,62	12.169,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,57	15.800,00	151.243,72	9,37	9,55	9,63	26.354,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,64	2.700,00	34.129,82	12,18	12,58	12,77	24.131,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	41,38	1.100,00	45.519,64	40,52	41,21	41,68	20.585,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	31,52	2.400,00	75.652,70	30,31	31,46	32,06	35.373,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	31,24	800,00	24.991,51	30,31	31,46	32,06	35.373,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	19,67	3.300,00	64.917,09	19,02	19,63	19,88	14.246,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	19,60	1.600,00	31.352,85	19,02	19,63	19,88	14.246,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	62,21	1.100,00	68.430,47	61,86	62,30	62,97	23.444,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	55,21	500,00	27.604,77	53,28	54,67	55,60	55.639,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	17,76	1.500,00	26.633,24	17,35	17,68	17,87	24.132,00	
30-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,35	1.700,00	17.600,70	9,51	10,18	10,50	13.678,00	
30-01-25	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,25	5.161,00	114.832,25	21,63	22,17	22,55	25.258,00	
30-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	CEOC11	38,04	601,00	22.860,85	37,56	37,97	38,98	327,00	
31-01-25	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	33,94	13.400,00	454.762,50	32,61	33,53	34,46	18.051,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	18,99	1.800,00	34.189,49	18,92	19,06	19,44	17.629,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,20	3.600,00	22.319,83	6,14	6,22	6,39	3.399,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ASA3	6,80	3.500,00	23.812,00	6,73	6,83	7,01	16.450,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	34,20	1.600,00	54.719,94	34,02	34,31	34,81	8.912,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	27,76	400,00	11.102,52	27,66	27,77	28,00	45.069,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,78	3.300,00	108.169,19	31,97	32,60	32,99	43.902,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,80	1.700,00	55.760,68	31,97	32,60	32,99	43.902,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ3	8,77	900,00	7.894,04	8,65	8,70	8,84	10.070,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ6	9,85	6.400,00	63.040,00	9,70	9,77	9,87	17.715,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ6	9,77	6.000,00	58.643,86	9,70	9,77	9,87	17.715,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,25	600,00	21.750,95	36,08	36,33	36,76	16.672,00	

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2025



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2025 À 31 DE JANEIRO DE 2025

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA				VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO		
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,77	1.900,00	22.368,97	11,68	11,76	11,86	13.620,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	40,33	1.500,00	60.490,50	39,66	40,10	40,57	11.161,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	40,45	3.000,00	121.350,00	39,66	40,10	40,57	11.161,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	30,33	3.200,00	97.071,44	30,10	30,29	30,65	25.975,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	30,50	2.800,00	85.400,00	30,10	30,29	30,65	25.975,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	14,98	700,00	10.488,64	14,91	14,99	15,24	7.084,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,43	31.000,00	75.274,48	2,41	2,43	2,50	38.108,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	18,43	3.000,00	55.290,00	18,27	18,42	18,58	10.103,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,53	9.100,00	86.763,94	9,48	9,54	9,64	33.690,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,65	1.800,00	22.769,07	12,57	12,66	12,83	19.854,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	37,89	400,00	15.154,38	37,25	37,84	38,37	62.289,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	PRIQ3	41,14	800,00	32.909,18	40,95	41,19	41,83	21.285,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	18,34	2.700,00	49.515,81	18,20	18,34	18,51	20.141,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,76	1.800,00	55.366,63	30,65	30,97	31,97	30.290,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,75	4.300,00	132.211,01	30,65	30,97	31,97	30.290,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	19,48	4.700,00	91.554,17	19,33	19,45	19,76	10.634,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	62,52	700,00	43.767,04	61,83	62,40	62,82	18.053,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	54,33	200,00	10.866,81	54,00	54,48	55,21	54.017,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	17,02	1.000,00	17.021,90	16,86	17,13	17,52	40.300,00	
31-01-25	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,21	1.100,00	11.233,59	10,05	10,25	10,48	17.002,00	
31-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ3	8,68	1.902,00	16.509,28	8,65	8,70	8,84	10.070,00	
31-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ3	8,77	1.633,00	14.316,90	8,65	8,70	8,84	10.070,00	
31-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ6	9,78	4.042,00	39.528,88	9,70	9,77	9,87	17.715,00	
31-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ6	9,73	2.245,00	21.834,33	9,70	9,77	9,87	17.715,00	
31-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ6	9,80	6.307,00	61.790,03	9,70	9,77	9,87	17.715,00	
31-01-25	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIQ3	41,46	93,00	3.855,80	40,95	41,19	41,83	21.285,00	
31-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	CBOP11	21,07	160,00	3.370,96	21,01	21,16	21,50	17,00	
31-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	FIGS11	42,33	188,00	7.957,99	41,99	42,51	43,20	1.147,00	
31-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	GARE11	7,94	11.005,00	87.415,95	7,85	7,90	7,96	35.238,00	
31-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HSRE11	101,10	18,00	1.819,80	101,09	101,09	101,10	8,00	
31-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	58,87	19,00	1.118,47	58,42	58,62	59,58	44,00	
31-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	34,54	594,00	20.514,50	33,99	34,21	35,01	445,00	
31-01-25	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	35,71	2.547,00	90.944,59	35,00	35,52	36,00	859,00	

7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

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

Mensalmente são disponibilizados no portal da Entidade, www.embraerprev.com.br, os seguintes relatórios:

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

8. GLOSSÁRIO

Administrador

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

Carteira

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

Dados Gerais

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

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

Duration

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

Vide também glossário de Valor Presente.

ETL (Expected Tail Loss)

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

Fundo de Investimento

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

Índice de Referência (*Benchmark*)

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

LDI (*Liability Driven Investments*)

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

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

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

Patrimônio de Cobertura

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

Patrimônio Líquido (PL)

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

Rating

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

Stress Testing

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

Tracking Error

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

Túnel de Preços

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

Valor Presente

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

Value at Risk (VaR)

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