



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Março/2023





## 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











Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/03/2023

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	4.209.887.422,27	VAR / PL:	1,3720%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,734,67		
VAR:	57.761.061,76	ETL / PL:	1,7206%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,191,75		
ETL:	72.434.701,74	VAR / CDI:	0,0154%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	199.940.317,10	Cenário Baixa - 10000 (+):	336.817.506,24	CENARIO BRADESCO 1 (+):	500.674.179,11	CENARIO BRADESCO 2 (+):	128.742.821,40		
Cenário Alta - 09999 (-):	(207.020.842,93)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(225.445.891,61)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(200.372.411,57)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(460.451.042,17)		
Cenário Alta - 09999:	(7.080.525,84)	Cenário Baixa - 10000:	111.371.614,64	CENARIO BRADESCO 1:	300.301.767,54	CENARIO BRADESCO 2:	(331.708.220,77)		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
VIXL14	2.042.541,68	308,05	176,42	0,00%	-1.502,34	1.216,62	2.261,24	-3.258,00	
VRDN12	4.689.138,33	73.573,82	56.967,35	0,10%	-315.439,21	235.376,39	241.969,10	-303.988,43	
VVEO15	1.748.875,05	710,73	471,61	0,00%	-2.702,38	2.220,08	3.836,98	-5.364,63	
VVEO16	1.111.857,43	511,91	343,06	0,00%	-1.892,72	1.558,49	2.670,30	-3.710,47	
VDOJ23	6.871,84	0,00	0,00	0,00%	-211.796,99	212.144,94	-262.105,57	264.069,52	
WDOK23	-3.828,62	34.756,10	-20.334,41	-0,04%	84.827,16	-86.248,94	111.109,75	-111.647,68	
WIEG3	9.045.488,50	472.387,84	222.720,35	0,39%	2.261.372,13	-2.261.372,13	1.326.068,61	-1.336.923,20	
WINJ23	18.519,60	70.059,48	-26.661,92	-0,05%	-169.341,10	169.277,97	-136.762,51	137.760,04	
XPIN11	2.947.348,59	69.015,96	2.723,68	0,00%	1.473.674,30	-1.473.674,30	432.081,30	-435.618,12	
XPPR11	2.340.097,10	512.942,42	128.441,62	0,22%	1.170.048,55	-1.170.048,55	343.058,24	-345.866,35	
YDUQ3	676.525,05	133.213,30	84.831,06	0,15%	263.844,77	-169.131,26	99.178,57	-99.990,40	
<b>Total Var:</b>	<b>4.326.276.929,09</b>	<b>127.723.295,83</b>	<b>57.761.061,76</b>	<b>99,95%</b>	<b>-7.080.525,83</b>	<b>111.371.614,64</b>	<b>300.301.767,54</b>	<b>-331.708.220,76</b>	

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/03/2023

EMBRAERPREV RENDA FIXA									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	3.119.073.870,86	VAR / PL:	1,6545%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2,287,04		
VAR:	51.603.915,32	ETL / PL:	2,0748%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,571,59		
ETL:	64.713.391,69	VAR / CDI:	0,0186%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	259.231.861,86	CENARIO BRADESCO 1 (+):	224.502.725,42	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	(153.347.128,59)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(250.221.317,42)		
Cenário Alta - 09999:	(153.347.128,59)	Cenário Baixa - 10000:	259.231.861,86	CENARIO BRADESCO 1:	224.502.725,42	CENARIO BRADESCO 2:	(250.221.317,42)		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
FI RF EMB II	2.516.857.204,45	46.485.513,42	46.374.244,39	89,87%	-124.510.052,72	236.075.820,08	173.301.482,64	-193.425.189,99	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	146.915.938,93	760.374,63	528.797,15	1,03%	-4.644.332,61	2.859.460,61	2.862.277,37	-3.744.742,67	
FIM EMB VI A CRED PRIV	245.419.436,39	1.176.290,02	650.608,19	1,07%	-4.021.574,65	5.320.539,34	32.962.138,50	-33.837.536,64	
FIM EMB VII A CRED PRIV	321.041.017,83	4.581.253,91	4.148.265,69	8,04%	-20.171.168,41	14.946.041,83	15.376.826,92	-19.223.848,12	
<b>Total Var:</b>	<b>3.232.233.597,47</b>	<b>53.003.432,18</b>	<b>51.603.915,32</b>	<b>100,01%</b>	<b>-153.347.128,59</b>	<b>259.231.861,86</b>	<b>224.502.725,42</b>	<b>-250.221.317,42</b>	

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/03/2023

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	493.404.662,38	VAR / PL:	7,1952%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	3,14		
VAR:	35.501.426,28	ETL / PL:	9,0231%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,10		
ETL:	44.520.220,61	VAR / CDI:	0,0809%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	120.840.014,24	Cenário Baixa - 10000 (+):	-	CENARIO BRADESCO 1 (+):	64.320.455,21	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	(119.326.375,41)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(64.851.438,05)		
Cenário Alta - 09999:	120.840.014,24	Cenário Baixa - 10000:	(119.326.375,41)	CENARIO BRADESCO 1:	64.320.455,21	CENARIO BRADESCO 2:	(64.851.438,05)		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
CAIXA	7.000.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
FIA RVA EMB II	206.860.273,67	14.320.278,17	14.216.048,68	40,04%	51.962.187,46	-52.450.895,75	29.493.142,16	-29.734.925,95	
FIA RVA EMB III	84.415.271,29	7.039.733,90	6.912.563,66	19,47%	22.069.303,23	-21.666.936,97	10.755.967,15	-10.947.853,22	
FIA RVA EMB IV	79.100.264,86	6.217.770,51	6.009.457,73	16,93%	23.077.683,27	-21.068.592,70	10.524.730,45	-10.611.332,07	
FIC FIA EMB VIII ETF	22.878.939,75	1.704.583,10	1.688.711,25	4,76%	0,00	0,00	0,00	0,00	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	93.150.921,10	6.717.897,62	6.674.644,95	18,80%	23.730.840,29	-24.139.949,98	13.546.595,46	-13.657.326,82	
<b>Total Var:</b>	<b>493.404.670,67</b>	<b>36.000.263,30</b>	<b>35.501.426,28</b>	<b>100,00%</b>	<b>120.840.014,25</b>	<b>-119.326.375,41</b>	<b>64.320.455,21</b>	<b>-64.851.438,05</b>	







RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO  
E RENTABILIDADE - MARÇO DE 2023



Data: 31/03/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO							
CNPJ:		4183766000109							
Dados Gerais									
PL:	234.663.608,53	VAR / PL:	0,5013%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	710,32		
VAR:	1.176.290,02	ETL / PL:	0,6286%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	487,06		
ETL:	1.475.115,14	VAR / CDI:	0,0056%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	2.029.125,58	Cenário Baixa - 10000 (+):	14.266.969,18	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	58.137.189,53	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	4.557.242,93		
Cenário Alta - 09999 (-):	(6.050.790,23)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(8.946.429,83)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(25.175.051,03)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(38.384.779,57)		
Cenário Alta - 09999:	(4.021.574,65)	Cenário Baixa - 10000:	5.320.539,34	CENÁRIO BRADESCO 1:	32.962.138,50	CENÁRIO BRADESCO 2:	(33.827.536,64)		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	Var paramétrico	Modelo	Volatilidade:	EWMA					
Int. Confiança:	95	Lâmbda:							
Horizonte:	21								
Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2	
AEGPA1	1.892.438,53	2.471,89	847,26	0,07%	-8.225,12	6.916,38	11.694,28	-15.720,69	
AMBP13	2.631.622,48	1.392,61	593,18	0,05%	-3.399,53	4.444,22	7.768,38	-10.059,39	
APRE28	1.350.756,90	154,54	73,93	0,01%	-663,38	593,36	960,04	-1.263,00	
BCBF15	3.179.634,15	302,44	173,89	0,01%	-1.570,30	1.268,94	2.433,34	-3.527,60	
BKBR18	1.509.639,71	35,65	23,29	0,00%	-252,36	204,93	431,99	-636,59	
BRELETR0	3.218.630,91	67.686,78	7.152,66	0,61%	0,00	0,00	0,00	0,00	
BRKPA0	2.176.203,47	1.396,44	583,27	0,05%	-5.225,74	4.293,54	7.352,11	-10.249,67	
CAIXA	10.000,21	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
CART13	917.083,03	14.578,32	9.339,40	0,79%	-62.259,54	46.549,50	47.936,65	-60.146,81	
CBAN22	4.680.026,40	29.106,80	2.439,56	0,21%	-54.933,49	51.623,79	83.169,75	-92.470,78	
CCPRA3	40.837,11	0,19	0,13	0,00%	-2,11	1,95	4,77	-7,12	
CEAB11	1.760.738,26	104,71	64,02	0,01%	-609,66	496,06	1.002,52	-1.465,82	
CEAB22	565.375,37	314,77	129,14	0,01%	-1.182,26	975,25	1.687,93	-2.344,14	
CELG12	3.272.334,65	568,61	297,28	0,03%	-2.564,21	2.075,59	3.763,09	-5.396,02	
COMPROMISSADA_PRE	94.213.736,03	0,00	0,00	0,00%	-2.622,43	2.674,16	12.240,01	-18.628,94	
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-93.897,13	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
CSAN23	1.121.958,10	2.056,45	619,89	0,05%	-6.437,85	5.540,61	9.410,00	-12.123,05	
CSMG17	2.105.214,16	1.251,43	445,60	0,04%	-4.279,04	3.584,25	6.095,06	-8.245,42	
DAPK23	-5.843,10	121.694,03	16.416,72	1,40%	517.824,49	36.407,80	8.124.409,34	-8.190.867,11	
DAPK25	-77.798,40	248.936,31	212.454,06	18,06%	-494.903,67	796.748,14	6.067.093,81	-6.110.677,17	
DAPK27	-6.461,42	23.097,61	18.507,40	1,57%	-72.406,13	84.463,16	391.497,05	-391.498,83	
DAPK35	1.087,59	14.797,16	-5.803,61	-0,49%	52.233,19	-54.608,16	-134.308,06	128.128,79	
DAPQ24	-172.969,07	415.271,67	297.179,79	25,26%	-637.779,22	1.392.933,81	13.156.345,32	-13.247.264,75	
DAPQ26	-85.447,82	299.622,85	275.695,17	23,44%	-919.560,40	1.157.091,69	6.099.097,17	-6.113.941,28	
DAPQ28	28.368,85	188.303,86	-120.322,99	-10,23%	659.344,92	-729.503,68	-2.871.751,68	2.855.983,60	
DAPQ30	19.238,22	82.727,94	-41.381,76	-3,52%	299.780,93	-318.898,97	-1.030.494,42	1.014.484,24	
DASAA2	2.732.271,17	37,66	24,25	0,00%	-255,76	210,16	457,55	-674,51	
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
DHF26	-3.493,51	107.534,14	40.172,17	3,42%	-354.634,10	292.332,65	478.527,51	-659.283,87	
DHF29	-125,51	4.542,92	-1.096,91	-0,09%	12.808,39	-11.347,12	-19.205,64	23.546,47	
DHN25	623,06	8.389,67	-3.721,60	-0,32%	30.686,40	-24.875,68	-41.351,89	58.053,96	
ELK27	573.062,10	1,16	-0,52	0,00%	61,36	-62,80	-249,87	300,50	
ERDVA0	2.089.341,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
GBSPI1	2.445.765,35	63.973,02	35.290,72	3,00%	-239.711,21	193.894,96	204.621,70	-242.795,11	
GGSH12	2.544.260,34	408,97	225,58	0,02%	-2.019,47	1.633,55	3.058,58	-4.412,23	
GUAR15	2.772.219,03	1.062,56	488,44	0,04%	-4.338,49	3.541,37	6.245,23	-8.815,77	
HARG11	3.409.207,78	59.865,11	36.955,38	3,14%	-247.987,51	188.034,90	196.557,02	-243.008,11	
HZTC14	2.344.004,47	35.929,37	23.359,22	1,99%	-155.583,49	114.329,75	118.537,82	-148.645,16	
IDF24P380200	-438.992,45	368.487,75	-244.909,18	-20,82%	438.988,92	-7.793.872,40	-21.052.751,77	438.992,45	
IDF24P380300	495.412,07	405.613,50	269.539,29	22,91%	-496.407,16	8.008.155,62	21.275.308,74	-495.412,07	
IGTAS3	2.087.883,59	1.128,08	-644,59	-0,05%	5.182,41	-4.064,11	-7.292,17	10.735,31	
INSSSN1	1.834.880,62	25.316,66	1.805,87	0,15%	0,00	0,00	0,00	0,00	
JSMLE5	3.038.841,08	46.906,94	30.464,38	2,59%	-201.652,36	149.748,36	152.230,56	-193.171,74	
LCAMA9	1.942.399,85	326,46	180,30	0,02%	-1.605,41	1.301,76	2.442,28	-3.525,86	
LCAMD1	4.692.554,68	75.012,27	48.106,50	4,09%	-319.139,12	238.181,68	242.326,41	-307.218,08	
LF0021003Q1	2.170.225,76	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LF002100E1F	1.185.385,71	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LF022000C9	2.234.936,38	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LFSC190054B	822.286,78	0,00	0,00	0,00%	3.445,27	-2.653,22	-4.977,33	7.633,58	
LFSC190059S	1.245.493,85	0,00	0,00	0,00%	5.238,45	-4.033,96	-7.561,43	11.596,99	
LFSC19005L1	823.953,76	0,00	0,00	0,00%	3.530,85	-2.719,74	-5.076,56	7.786,84	
LFSC22002X	4.945.341,55	3.788,87	1.527,84	0,13%	-13.909,87	11.482,70	19.676,00	-27.342,62	
LFNS210029N	3.583.598,89	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LFT2024031 - 210100	10.185.771,26	1.099,46	-50,24	0,00%	-25.833,87	32.257,89	209,88	-319,53	
LFT2024091 - 210100	1.094.043,40	167,56	-26,44	0,00%	-152,18	6.026,16	43,11	-65,63	
LIGHB4	2.177.528,25	15,29	10,40	0,00%	-159,10	138,26	333,09	-496,88	
LIGHD3	859.219,60	744,57	267,46	0,02%	-2.539,39	2.120,01	3.584,15	-4.873,83	
LREN11	1.377.056,52	42,41	26,66	0,00%	-263,05	215,79	446,36	-655,19	
MOVI27	1.166.162,56	1.800,11	615,46	0,05%	-5.982,98	5.032,23	8.501,47	-11.418,77	
MTRJ19	3.398.465,90	36.514,08	26.640,29	2,26%	-177.375,86	123.732,52	124.729,11	-159.966,45	
NTEN11	3.463.349,99	33.825,06	27.150,21	2,31%	-167.784,68	109.503,29	11.321,53	-144.138,47	
NTNB20230515 - 760199_NEGOCIACAO	87.677,17	158,83	26,52	0,00%	-145,89	141,66	85,36	-115,71	
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	102.447,73	523,53	408,29	0,03%	-1.821,16	1.330,37	1.252,00	-1.874,40	
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	586.883,05	3.619,96	3.204,61	0,27%	-13.217,05	13.009,51	9.853,07	-13.099,66	
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	1.495.580,90	12.738,48	11.498,31	0,98%	-47.869,79	52.661,72	39.232,98	-61.558,19	
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	690.912,78	6.989,08	5.671,02	0,48%	-25.177,63	28.119,96	21.359,43	-27.882,35	
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	4.681.728,08	56.112,06	36.708,66	3,12%	-200.251,55	246.415,98	191.697,53	-247.040,88	
NTNB20250815 - 760199_NEGOCIACAO	394.906,05	13.177,91	4.924,72	0,42%	-35.654,28	73.123,35	63.011,47	-57.904,54	
NTS035	1.859.842,59	3.760,15	1.099,75	0,09%	-11.636,98	10.097,03	17.211,95	-21.793,37	
OMGE13	3.616.796,03	3.001,23	1.070,79	0,09%	-10.254,51	8.591,90	14.535,12	-19.761,87	
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
OVSIA0	1.558.420,77	402,32	205,88	0,02%	-1.803,23	1.462,17	2.656,61	-3.802,03	
PASN12	3.163.307,96	24.316,46	20.110,77	1,71%	-132.562,47	86.758,73	86.876,72	-112.719,13	
RAHD11	3.117.391,81	61.034,44	36.766,69	3,13%	-248.423,02	188.535,73	199.465,02	-243.639,58	
RBCAPM2	685.070,70	10.788,06	-3.000,22	-0,26%	0,00	0,00	0,00	0,00	
RDCO10	2.248.971,29	654,79	317,87	0,03%	-2.824,72	2.300,57	4.142,04	-5.893,18	
RDR089	1.111.779,48	1.953,31	596,61	0,05%	-6.114,47	5.262,96	8.937,42	-11.510,96	
RLOG11	1.516.566,17	116,12	68,94	0,01%	-631,10	511,26	992,00	-1.442,62	
RSAN24	792.067,19	95,19	52,23	0,00%	-467,34	379,84	714,72	-1.031,60	
RSAN44	819.064,43	8.796,81	6.873,39	0,58%	-42.055,59	29.321,59	29.176,09	-37.605,22	
SBFC11	1.712.663,69	22,58	14,92	0,00%	-196,15	167,89	393,02	-583,90	
SNGO18	2.272.721,13	196,60	114,00	0,01%	-1.046,11	849,33	1.644,57	-2.387,91	
UGEL11	909.362,12	279,10	130,73	0,01%	-1.159,43	944,52	1.663,34	-2.351,04	
UNEG11	5.112.070,12	117.774,36	66.049,42	5,62%	-458.101,17	356.548,88	379.883,11	-460.715,13	
VAMO33	1.425.856,81	21.939,47	14.115,11	1,20%	-94.479,59	68.722,88	70.517,45	-89.898,36	
VCS11	1.300.445,46	1.784,87	572,74	0,05%	-5.734,73	4.963,72	8.209,28	-10.8	



Data: 31/03/2023

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais			
PL:	263.732.770,29	VAR / PL:	1,7371%
VAR:	4.581.253,91	ETL / PL:	2,1784%
ETL:	5.745.077,23	VAR / CDI:	0,0195%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		0,00% Duration DC:	2,031,07
		Duration DU:	1,395,47

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	14.946.041,83	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.376.826,92	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(20.171.168,41)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(19.223.848,12)
Cenário Alta - 09999:	(20.171.168,41)	Cenário Baixa - 10000:	14.946.041,83	CENARIO BRADESCO 1:	15.376.826,92	CENARIO BRADESCO 2:	(19.223.848,12)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANEM11	12.090.643,07	207.875,99	206.051,79	4,50%	-851.558,95	552.252,02	583.347,78	-843.876,31
ANET11	2.289.619,42	15.619,23	13.975,65	0,31%	-36.937,78	55.713,97	54.791,12	-71.645,58
BRKP28	4.977.632,90	102.415,46	101.530,77	2,22%	-402.814,38	321.222,34	329.986,20	-409.903,15
BRST11	6.455.816,63	52.484,17	44.540,66	0,97%	-259.107,70	175.628,11	166.139,78	-217.937,08
BTOW15	7.922.494,49	126.875,35	126.577,96	2,76%	-537.684,23	404.927,41	411.179,21	-520.602,48
CAEC21	8.360.361,05	90.688,54	86.052,70	1,88%	-428.768,39	291.666,67	289.024,87	-375.292,90
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	5.395.306,67	85.765,94	85.670,83	1,87%	-366.280,16	273.856,13	282.016,90	-353.850,71
CBANS2	9.311.234,08	155.067,24	154.717,56	3,38%	-656.020,83	487.735,84	504.588,44	-634.366,95
CBANT2	2.255.337,35	39.606,96	39.486,36	0,86%	-165.183,04	123.912,16	123.309,15	-161.036,74
CJEH13	4.483.633,24	69.529,67	69.480,66	1,52%	-299.191,85	223.439,64	230.116,84	-288.321,93
CNRD11	9.588.832,78	173.385,26	172.799,06	3,77%	-713.093,18	547.518,06	566.107,46	-704.190,13
COMPROMISSADA_PRE	10.668.455,57	0,00	0,00	0,00%	-296,96	302,81	1.386,02	-2.109,48
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-156.732,23	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	9.525.483,03	100.497,05	96.179,48	2,10%	-484.820,67	327.050,53	326.937,69	-423.803,96
CREDZMZ4	1.481.263,98	121.866,92	-48.886,36	-1,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	4.642.812,80	45.661,89	44.905,21	0,98%	-227.664,94	155.549,00	157.337,54	-202.385,70
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EGIEA0	3.359.360,37	94.527,00	92.171,72	2,01%	-342.159,59	292.640,09	302.187,71	-352.077,32
ERDV17	3.737.125,04	16.092,46	7.620,87	0,17%	-89.893,25	42.310,64	47.347,82	-63.172,84
ERDV38	5.746.924,55	38.270,26	24.804,29	0,54%	-182.225,49	111.746,04	106.848,02	-141.526,81
GBSP11	7.508.678,14	196.401,86	192.527,15	4,20%	-735.930,90	595.271,68	628.203,56	-745.398,71
GRRB24	7.980.638,46	94.979,76	92.029,75	2,01%	-443.025,75	295.272,37	301.695,93	-390.084,80
HARG11	4.048.975,63	71.099,32	70.834,57	1,55%	-294.524,55	223.321,30	233.442,67	-288.610,72
HBSA21	4.454.098,36	71.154,74	70.973,87	1,55%	-300.700,17	224.825,18	229.134,08	-290.175,64
HVRD15	9.831.394,43	195.438,70	194.705,07	4,25%	-787.369,05	604.918,16	623.573,73	-778.504,03
IPIL11	8.704.679,32	113.501,74	113.377,59	2,47%	-515.525,47	374.178,28	383.069,29	-483.260,77
IRBR12	11.035.044,58	84.376,31	65.496,50	1,43%	-410.450,47	279.991,45	259.229,35	-341.438,47
ITPO14	12.677.565,48	280.175,68	278.165,14	6,07%	-1.100.292,13	855.955,73	893.541,38	-1.103.458,60
LAMEA6	5.247.929,48	127.183,27	126.902,06	2,77%	-542.760,08	404.475,00	411.136,00	-521.454,31
LCAMD1	4.630.378,33	74.018,36	73.830,26	1,61%	-314.910,53	235.025,77	239.115,58	-303.147,44
LIGHD7	5.734.295,12	43.340,85	32.702,74	0,71%	-209.364,73	141.784,36	131.199,80	-173.030,48
LORTA7	5.855.705,77	96.347,75	96.075,81	2,10%	-406.785,72	304.440,89	309.990,48	-392.904,72
MOVI37	8.032.564,91	124.929,79	124.637,10	2,72%	-535.858,82	398.365,92	405.041,02	-513.871,20
MTRJ19	2.600.615,58	27.941,75	27.639,73	0,60%	-135.733,72	94.684,11	95.446,74	-122.426,78
NTEJ11	6.702.347,98	66.458,98	62.762,74	1,37%	-324.700,46	211.913,08	215.431,77	-278.939,81
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	7.258.295,67	55.794,78	52.939,93	1,16%	-304.165,18	199.070,25	199.340,98	-258.637,10
PEJA11	11.205.291,83	160.513,38	159.929,25	3,49%	-704.975,78	518.296,87	524.079,25	-666.523,84
QUAT12	4.513.702,22	30.261,58	20.033,96	0,44%	-148.669,71	89.321,50	86.816,07	-115.013,30
RAHD11	11.560.479,86	226.339,02	224.824,59	4,91%	-921.247,46	699.162,51	739.692,50	-903.508,65
RDVE11	3.787.754,01	64.476,92	64.423,37	1,41%	-271.867,13	203.660,95	211.454,15	-262.650,09
RMSA12	5.836.586,67	170.026,48	166.645,33	3,64%	-629.342,13	501.711,62	536.263,31	-640.672,75
RSAN44	5.262.488,99	56.519,48	54.959,56	1,20%	-270.207,16	188.391,20	187.456,35	-241.613,52
TCH11	12.565.673,71	269.532,49	267.271,51	5,83%	-1.077.445,55	817.370,89	871.454,38	-1.056.767,47
UHSM12	1.845.637,06	44.114,06	43.401,92	0,95%	-168.815,26	132.707,94	140.968,59	-171.747,57
UNEG11	1.808.634,28	41.669,20	41.021,95	0,90%	-162.074,75	126.145,67	134.401,45	-162.999,56
UTPS11	3.993.353,39	26.753,58	23.423,28	0,51%	-145.325,50	89.885,23	89.351,76	-117.064,66
UTPS21	4.173.825,78	81.491,66	80.937,57	1,77%	-326.960,08	252.045,54	263.198,72	-325.518,24
UTPS22	2.649.163,40	54.491,84	54.031,50	1,18%	-215.842,29	167.478,19	175.142,79	-216.209,31
VAMO33	6.041.761,90	92.540,13	92.259,51	2,01%	-400.337,25	291.202,88	298.802,73	-379.654,05
VAMO34	6.843.188,73	104.558,93	104.330,52	2,28%	-447.372,50	332.091,90	338.362,23	-428.961,84
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIMT13	6.824.125,59	117.441,71	116.973,18	2,55%	-490.354,56	370.217,33	386.108,67	-479.509,19
VRDN12	4.689.138,33	73.573,82	73.502,68	1,60%	-315.439,21	235.376,39	241.969,10	-303.988,43
Total Var:	321.041.017,77	4.872.376,33	4.581.253,91	100,01%	-20.171.168,41	14.946.041,82	15.376.826,92	-19.223.848,11



Data: 31/03/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		FIM EMB I A							
CNPJ:		20725946000122							
Dados Gerais									
PL:	387.712.970,04	VAR / PL:	0,1624%	Limite Fundo:	0,00%		Dutacion DC:		52,76
VAR:	629.832,89	ETL / PL:	0,2037%	Status:	ENQUADRADO		Dutacion DU:		35,17
ETL:	789.835,86	VAR / CDI:	0,0018%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	43.619.357,92	Cenário Baixa - 10000 (+):	64.772.549,59	CENARIO BRADESCO 1 (+):	174.533.045,89	CENARIO BRADESCO 2 (+):	120.846.999,65		
Cenário Alta - 09999 (-):	(47.769.477,54)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(63.954.966,67)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(172.402.259,48)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(127.570.470,56)		
Cenário Alta - 09999:	(4.150.119,62)	Cenário Baixa - 10000:	817.582,92	CENARIO BRADESCO 1:	2.130.786,42	CENARIO BRADESCO 2:	(6.723.470,91)		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
ANHB10	763.036,17	59,06	56,51	0,01%	-269,17	218,39	397,95	-569,37	
BDF14	260.014,76	22,25	19,59	0,00%	-119,58	96,36	183,76	-266,71	
CAIXA	9.000,01	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
CBAN22	2.253.639,81	13.992,29	12.793,12	2,03%	-26.244,31	24.816,71	39.981,55	-44.452,77	
CGBP13	2.334.422,54	1.614,21	1.611,07	0,26%	-5.560,60	4.656,03	7.928,91	-10.735,00	
COMPROMISSADA_PRE	352.268.036,62	0,00	0,00	0,00%	-9.805,35	9.998,77	45.765,78	-69.654,19	
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-49.125,25	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
CPMK23C100000	5.787,95	1.185,36	151,96	0,02%	-3,54	3,62	15,81	-23,99	
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
DIF24	-13.763,79	90.885,96	48.407,39	7,69%	-692.696,95	569.473,87	1.228.934,79	-1.816.090,05	
DIF25	-173,90	1.496,72	1.422,69	0,23%	-6.201,44	4.943,28	8.546,01	-12.203,54	
DIF26	-2.653,30	81.671,50	81.516,41	12,94%	-269.342,35	222.024,80	363.438,61	-500.721,93	
DIF27	3.781,19	501.038,14	497.299,69	78,96%	-1.483.794,99	1.260.286,05	2.056.610,67	-2.729.419,13	
DIF31	-165,36	25.142,48	-24.334,50	-3,86%	-3.86%	72.267,12	-116.602,76	131.872,53	
DIH23	-2,06	0,12	-0,01	0,00%	-97,37	99,29	454,48	-691,71	
DIH23	5,22	-6,53	-6,53	0,00%	506,46	-517,77	-1.565,68	2.359,26	
DIV23	1.486,25	7.988,08	-3.105,79	-0,49%	89.730,43	-77.809,33	-183.361,91	273.496,42	
DOLJ23	-6.871,84	0,00	0,00	0,00%	211.766,99	-212.144,94	262.105,57	-264.069,52	
DOLK23	3.826,62	34.756,10	10.548,29	1,67%	-84.827,16	86.248,94	-111.109,75	111.647,68	
ELET13	2.160.563,08	528,04	509,04	0,08%	-2.288,00	1.850,03	3.287,35	-4.687,33	
EQTL13	1.521.684,58	31,24	19,88	0,00%	-228,52	185,29	389,62	-574,38	
ETEN13	1.298.164,27	5,57	2,15	0,00%	-64,51	57,84	145,23	-217,24	
GRNB14	1.079.329,86	104,42	106,36	0,02%	-462,28	575,38	679,96	-969,49	
IDF24C382500	-1.391.111,93	1.162.239,08	617.962,83	93,12%	-30.740.459,45	1.392.978,59	1.391.111,93	-97.120,36	
IDF24C382600	1.363.218,49	1.173.531,69	-625.042,65	-99,24%	33.715.309,60	-1.363.034,31	-1.363.218,49	108.071.427,25	
IDF24C382700	-124.636,72	110.713,93	58.968,10	9,36%	-3.462.254,80	124.623,20	124.636,72	-11.262.654,07	
IDF24P381200	882.235,64	537.275,66	286.162,05	45,43%	-882.148,93	6.284.167,27	14.977.897,43	-882.235,64	
IDF24P381300	-964.706,60	569.839,30	-303.505,99	-48,19%	964.592,16	-6.381.731,90	-15.078.277,55	964.706,60	
IDF24P381600	-1.229.167,98	668.571,81	-356.092,59	-56,54%	1.228.950,44	-6.657.783,89	-15.362.369,42	1.229.167,98	
IDF24P381700	1.326.103,55	701.668,17	373.720,26	59,34%	-1.325.838,54	6.741.176,33	15.448.284,93	-1.326.103,55	
IDF24P381800	1.428.003,91	734.606,09	381.263,55	62,12%	-1.427.681,24	6.819.863,36	15.529.235,65	-1.428.003,91	
IDF24P381900	-1.534.854,60	767.220,42	-408.634,49	-64,98%	1.534.461,94	-6.893.245,16	-15.605.236,04	1.534.854,60	
IDF24P382400	-2.141.087,67	919.823,27	-489.913,33	-77,78%	2.140.050,06	-7.189.567,92	-15.913.258,37	2.141.087,68	
IDF24P382500	2.275.932,21	947.226,09	504.508,54	80,10%	-2.274.674,87	7.235.274,01	15.961.264,91	-2.275.932,21	
IDU23P348000	24,60	0,05	0,00	0,00%	-19,57	80,41	5.079,72	-24,60	
IDU23P348100	-546.007,28	197,01	13,70	0,00%	156.866,00	-160.807,16	-736.228,72	545.976,41	
IDU23P348200	1.465.500,60	132,94	-9,25	0,00%	-106.297,57	108.434,96	496.407,56	-746.013,62	
IDIN23C359100	-5.112,77	3.820,92	1.217,67	0,19%	-523.932,51	5.112,77	5.112,77	-2.679.832,46	
IDIN23C359200	2.041,20	1.429,55	-455,65	-0,07%	464.374,30	-2.041,20	2.041,20	2.820.674,56	
IDIN23P358900	287.845,47	149.340,62	47.600,47	7,56%	-287.845,47	15.688.480,28	51.990.741,32	-287.845,47	
IDIN23P359000	-864.579,72	370.575,71	-118.116,41	-18,75%	864.579,72	-18.319.845,09	-57.343.419,63	864.579,72	
IDIN23P359100	-1.709.198,45	523.996,94	-167.017,52	-26,52%	1.709.198,46	-15.818.711,29	-47.524.161,34	1.709.198,46	
IDIN23P359200	3.549.674,12	636.635,35	202.919,62	32,22%	-3.549.674,12	17.038.316,82	51.665.360,76	-3.549.674,12	
IDIN23P359300	142.971,99	17.961,75	5.725,08	0,91%	-142.971,95	461.598,69	1.397.471,02	-142.971,99	
IDIN23P359400	-381.861,00	36.519,01	-11.639,98	-1,85%	381.877,09	-925.154,27	-2.799.303,04	381.861,00	
IDIN23P359500	238.839,32	18.305,14	5.834,54	0,93%	-238.809,03	462.312,47	1.398.705,54	-238.839,32	
IVIAS5	1.353.263,72	50,30	42,07	0,01%	-293,22	238,42	481,16	-703,53	
LF0021006S0	1.139.887,84	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LF002100HDP	1.354.692,27	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LF002100HDQ	2.414.886,22	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LF002100ISJ	2.587.905,12	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LF0220018H	1.155.028,78	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LFSC1900089	3.368.459,17	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LFT20230901 - 210100	2.605.070,22	153,24	-6,31	0,00%	-2.429,47	2.720,75	50,19	-76,41	
NTNB20230515 - 760199_NEGOCIACAO	2.788.969,15	5.052,41	-3.788,55	-0,60%	-4.640,71	4.506,23	2.715,38	-3.680,66	
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	23.933,70	798,66	662,81	0,11%	-2.160,87	4.431,72	3.212,82	-3.509,37	
OMGE13	964.288,18	800,17	798,68	0,13%	-2.736,66	2.290,72	3.888,60	-5.268,79	
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
PRLG14	2.368.701,35	5,33	2,75	0,00%	-47,09	40,33	95,98	-142,73	
VAMC22	1.079.422,57	195,67	167,65	0,03%	-883,37	722,46	1.317,28	-1.984,75	
WDOJ23	6.871,84	0,00	0,00	0,00%	-211.766,99	212.144,94	-262.105,57	264.069,52	
WDOK23	-3.826,62	34.756,10	-10.548,29	-1,67%	84.827,16	-86.248,94	111.109,75	-111.647,68	
<b>Total Var:</b>	<b>389.107.316,29</b>	<b>10.851.984,53</b>	<b>629.832,89</b>	<b>100,03%</b>	<b>-4.150.119,62</b>	<b>817.582,92</b>	<b>2.130.786,42</b>	<b>-6.723.470,91</b>	



Data: 31/03/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB II A  
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais		Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	491,35
PL:	183.309.330,41	VAR / PL:	0,1915%	ENQUADRADO	336,58
VAR:	350.978,63	ETL / PL:	0,2401%		
ETL:	440.141,36	VAR / CDI:	0,0022%		

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	1.834.985,29	Cenário Baixa - 10000 (+):	3.043.769,64	CENARIO BRADESCO 1 (+):	3.736.728,90
Cenário Alta - 09999 (-):	(3.092.215,79)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.561.281,64)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.783.507,21)
Cenário Alta - 09999:	(1.257.230,49)	Cenário Baixa - 10000:	1.482.488,00	CENARIO BRADESCO 1:	1.953.221,69
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	2.347.019,45
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(4.803.898,63)
				CENARIO BRADESCO 2:	(2.456.879,19)

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
AEGP13	661.633,89	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	18.131.331,78	0,00	0,00	0,00%	-504,68	514,64	2.355,58	-3.585,12
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-37.719,48	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT14	146.870,16	9,17	-6,03	0,00%	139,32	-135,03	-379,13	576,89
CPGT16	294.610,63	63,60	-43,37	-0,01%	356,34	-287,89	-577,46	659,26
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
D1F24	486,35	3.211,52	-1.933,03	-0,55%	24.473,39	-20.122,75	-43.425,26	64.172,79
D1F25	-7.477,79	64.359,17	43.432,98	12,37%	-266.661,74	212.561,01	367.476,45	-524.752,18
D1F26	-88,44	2.722,38	1.572,19	0,45%	-8.978,08	7.400,83	12.114,62	-16.690,73
D1F27	332,41	44.047,31	22.740,39	6,48%	-130.443,52	110.794,38	180.800,94	-239.948,93
D1F29	125,51	4.542,92	2.161,21	0,62%	-12.808,39	11.347,12	19.205,64	-23.546,47
D1F33	19,57	4.383,67	2.106,11	0,60%	-12.638,93	12.002,22	21.658,04	-22.621,25
D1J23	-0,18	0,01	0,00	0,00%	-8,35	8,51	38,96	-59,29
D1J24	-225,72	1.393,28	911,81	0,26%	-8.788,47	6.924,54	13.749,02	-20.140,25
D1J25	-85,97	897,08	596,75	0,17%	-3.492,55	2.811,49	4.731,97	-6.700,00
D1N23	46,96	184,49	-88,56	-0,03%	4.558,17	-4.657,58	-14.091,14	21.233,35
D1N24	178,86	1.285,39	-875,81	-0,25%	6.636,61	-5.249,69	-9.837,26	14.289,02
D1N25	14.797,74	199.254,64	-125.749,10	-35,83%	728.801,96	-590.797,40	-982.107,39	1.378.781,55
D1N26	779,37	125.691,94	-68.305,06	-19,46%	390.034,72	-325.653,65	-532.466,52	720.269,86
D1V23	-12,34	66,57	36,51	0,01%	-747,75	646,41	1.528,02	-2.279,14
D1V24	-158,16	1.779,38	1.207,59	0,34%	-8.008,77	6.350,05	11.373,88	-16.379,95
DOLK23C005400	4.539,00	7.845,62	-3.196,68	-0,91%	69.099,82	-4.508,34	95.667,84	-4.537,58
DOLK23C005600	-1.345,00	2.720,73	1.108,55	0,32%	-38.312,43	1.341,89	-58.819,66	1.344,91
ERDV18	1.423.531,33	6,73	3,95	0,00%	-70,33	60,93	146,69	-218,82
INDJ23	-66.429,00	251.300,31	90.188,16	25,70%	607.419,15	-607.192,73	490.561,18	-494.139,27
LFSC18002GT	431.643,48	0,00	0,00	0,00%	1.632,47	-1.267,90	-2.529,35	3.878,17
LFSC1900089	3.368.459,17	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC19000H7	419.471,29	0,00	0,00	0,00%	1.833,36	-1.406,68	-2.511,54	3.851,59
LFT20230901 - 210100	41.251.286,97	2.426,62	-272,22	-0,08%	-38.470,63	43.083,11	794,75	-1.209,96
LFT20240301 - 210100	8.049.624,86	868,88	-142,44	-0,04%	-20.416,03	25.492,81	165,87	-252,52
LFT20240901 - 210100	22.297.646,46	3.410,95	-707,50	-0,20%	-90.739,65	122.818,88	878,60	-1.337,57
LFT20250901 - 210100	9.218.001,65	2.542,03	1,80	0,00%	-61.664,06	94.110,06	1.187,47	-1.807,60
LFT20260901 - 210100	1.726.349,55	1.131,41	27,73	0,01%	-11.468,17	30.012,85	1.572,36	-2.391,12
LTN20230701 - 100000	1.976.811,59	420,33	127,20	0,04%	-5.133,40	5.311,12	15.978,08	-24.076,57
LTN20240101 - 100000	2.280.244,42	4.141,07	2.319,32	0,66%	-30.451,22	25.293,96	54.315,03	-80.263,83
LTN20250701 - 100000	15.376.346,67	206.960,34	130.180,24	37,09%	-739.222,41	635.939,03	1.027.638,38	-1.442.092,05
LTN20260701 - 100000	5.916.656,48	127.337,76	68.928,77	19,64%	-376.766,85	357.272,51	550.354,72	-743.464,24
NTNB20230515 - 760199_NEGOCIACAO	15.548.085,51	26.166,45	-891,57	-0,25%	-25.871,26	25.121,68	15.137,86	-20.519,13
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	12.428.955,76	63.514,95	36.162,16	10,30%	-220.943,51	222.060,76	151.892,45	-203.138,70
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	3.793.779,70	23.400,44	17.259,01	4,92%	-85.438,80	84.097,19	63.693,09	-84.679,95
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	9.532.774,69	81.194,55	68.612,94	19,55%	-305.120,16	335.663,78	250.069,52	-328.629,90
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	5.072.310,90	51.310,05	41.152,94	11,73%	-184.840,64	206.441,63	156.809,50	-204.697,22
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	5.490.915,65	65.810,45	47.492,04	13,53%	-234.862,93	289.006,39	224.830,44	-289.739,31
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WINJ23	18.519,60	70.059,48	-25.143,37	-7,16%	-169.341,10	169.277,87	-136.762,51	137.760,04
<b>Total Var:</b>	<b>184.372.325,90</b>	<b>1.448.061,67</b>	<b>350.978,63</b>	<b>100,02%</b>	<b>-1.257.230,50</b>	<b>1.482.488,00</b>	<b>1.953.221,69</b>	<b>-2.456.879,18</b>



Data: 31/03/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO  
CNPJ: 3271199000162

Dados Gerais					
PL:	56.265.528,58	VAR / PL:	1,4846%	Limite Fundo:	0,00% Dutation DC:
VAR:	835.341,78	ETL / PL:	1,8618%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	1.047.552,29	VAR / CDI:	0,0167%	Benchmark:	Dutation DU:
					3,00
					1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	30.833.939,25	Cenário Baixa - 10000 (+):	3,49	CENARIO BRADESCO 1 (+):	7.394.582,75
Cenário Alta - 09999 (-):	(3,43)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(30.833.940,89)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	30.833.935,82	Cenário Baixa - 10000:	(30.833.937,39)	CENARIO BRADESCO 1:	7.394.582,75
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(7.455.119,61)
				CENARIO BRADESCO 2:	(7.455.119,61)

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	2.210.335,00	87.857,45	-22.839,84	-2,73%	1.105.167,50	-1.105.167,50	324.035,11	-326.687,51
BMLC11	2.942.736,00	71.605,48	8.147,23	0,98%	2.942.736,00	-2.942.736,00	431.405,10	-434.936,38
BPML11	891.464,00	24.473,48	2.072,82	0,25%	891.464,00	-891.464,00	130.688,62	-131.758,38
BTLG11	93.450,61	3.523,04	-501,91	-0,06%	46.725,21	-46.725,21	13.699,86	-13.812,00
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	746.463,70	31.199,85	17.616,21	2,11%	373.231,85	-373.231,85	109.431,58	-110.327,34
CNES11	460.263,54	24.933,43	11.261,17	1,35%	230.130,23	-230.131,77	67.474,64	-68.026,95
COMPROMISSADA_PRE	123.087,84	0,00	0,00	0,00%	-3,43	3,49	15,99	-24,34
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-45.080,93	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FVPQ11	948.150,00	67.499,35	48.257,62	5,78%	474.075,00	-474.075,00	138.998,79	-140.136,57
GALG11	1.713.883,07	52.747,16	-22.521,34	-2,70%	856.941,54	-856.941,54	251.255,26	-253.311,92
GTLG11	1.366.718,85	32.028,59	13.502,14	1,62%	1.366.718,85	-1.366.718,85	200.360,98	-202.001,05
HBRH11	2.625.924,24	121.132,91	36.191,18	4,33%	2.625.924,24	-2.625.924,24	384.960,49	-386.111,60
HSLG11	2.321.006,51	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
HSML11	3.494.245,50	133.192,53	29.457,07	3,53%	1.747.122,75	-1.747.122,75	512.256,39	-516.449,49
MALL11	2.318.085,00	62.195,12	9.751,95	1,17%	1.159.042,50	-1.159.042,50	339.831,26	-342.612,96
MAXR11	1.204.288,00	194.818,16	-15.726,84	-1,88%	602.144,00	-602.144,00	176.548,62	-177.993,77
NEWL11	937.904,75	24.027,78	18.283,58	2,19%	468.952,38	-468.952,38	137.496,84	-138.622,32
NEWU11	851.455,20	212.297,36	45.847,22	5,49%	851.455,20	-851.455,20	124.823,33	-125.845,08
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	4.900.819,35	267.743,53	167.312,60	20,03%	2.450.409,68	-2.450.409,68	718.460,12	-724.341,10
QAGR11	4.490.780,24	153.500,10	393,36	0,05%	2.240.394,12	-2.240.394,12	656.863,56	-662.260,50
RBRL11	2.549.155,37	195.136,96	111.811,36	13,39%	2.549.155,37	-2.549.155,37	373.706,18	-376.765,16
RCRB11	4.196.574,29	180.770,81	101.522,57	12,15%	0,00	0,00	0,00	0,00
RNGO11	38.511,60	1.335,17	-443,14	-0,05%	19.255,80	-19.255,80	5.645,80	-5.692,01
TEPP11	4.023.043,20	158.070,11	-1.805,88	-0,22%	2.011.521,60	-2.011.521,60	589.778,13	-594.605,79
TRXF11	6.355.297,20	77.071,93	43.617,87	5,22%	3.177.648,60	-3.177.648,60	931.686,57	-939.312,93
XPIN11	2.947.348,59	69.015,96	48.924,81	5,86%	1.473.674,30	-1.473.674,30	432.081,30	-435.618,12
XPPR11	2.340.097,10	512.942,42	185.209,98	22,17%	1.170.048,55	-1.170.048,55	343.058,24	-345.866,35
<b>Total Var:</b>	<b>57.037.015,81</b>	<b>2.759.198,67</b>	<b>835.341,78</b>	<b>100,03%</b>	<b>30.833.935,82</b>	<b>-30.833.937,39</b>	<b>7.394.582,75</b>	<b>-7.455.119,61</b>



Data: 31/03/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:	FIA RVA EMB II
CNPJ:	13294268000125

Dados Gerais	
PL:	206.860.275,49
VAR:	14.320.278,16
ETL:	17.968.206,55
VAR / PL:	6,9227%
ETL / PL:	6,6813%
VAR / CDI:	0,0778%
Limite Fundo:	916.843,43
Status:	ENQUADRADO
Benchmark:	0,00% Dutation DC: 3,00
	0,00% Dutation DU: 1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	51.962.340,28	Cenário Baixa - 10000 (+):	155,86	CENARIO BRADESCO 1 (+):	29.493.142,14
Cenário Alta - 09999 (-):	(152,84)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(52.451.051,59)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	51.962.187,44	Cenário Baixa - 10000:	(52.450.895,73)	CENARIO BRADESCO 1:	29.493.142,14
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(29.734.925,93)
				CENARIO BRADESCO 2:	(29.734.925,93)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	6.548.881,65	840.175,37	-457.393,42	-3,19%	916.843,43	-1.954.710,20	960.066,05	-967.924,71
ARZZ	1.136.829,00	211.594,78	183.923,96	1,28%	341.048,70	-341.050,49	166.659,13	-166.023,33
B3SA3	7.705.875,15	980.633,66	456.543,67	3,19%	1.926.468,79	-1.926.468,79	1.129.681,30	-1.138.928,35
BBAS3	7.309.659,00	1.049.242,79	906.943,12	6,33%	1.827.414,75	-1.827.414,75	1.071.596,01	-1.080.367,60
BBDC4	8.392.977,60	691.048,61	330.058,00	2,30%	2.098.244,40	-2.098.244,40	1.230.410,52	-1.240.482,09
BBSE3	2.760.099,00	351.936,92	285.458,39	1,99%	552.011,31	-552.019,80	404.630,51	-407.942,63
BEF3	2.002.600,00	400.736,95	270.689,33	1,89%	500.650,00	-500.650,00	293.581,16	-295.984,28
BPAC11	2.743.140,00	216.610,62	101.575,62	0,71%	822.942,00	-960.099,00	402.144,32	-405.436,09
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CSAV3	1.590.284,00	634.024,25	505.193,38	3,53%	636.113,60	-636.113,60	233.135,63	-235.043,98
CCRO3	1.118.720,00	145.361,87	2.589,05	0,02%	279.680,00	-279.680,00	164.004,35	-165.346,82
CIEL3	2.543.825,00	235.520,10	149.162,48	1,04%	763.147,50	-635.956,25	372.924,75	-375.977,34
COMPROMISSADA_PRE	5.491.084,40	0,00	0,00	0,00%	-152,84	155,86	713,39	-1.085,76
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	183.003,95	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	2.259.810,00	195.480,12	84.173,34	0,59%	451.962,00	-451.962,00	331.288,15	-333.999,92
CSMG3	1.481.766,00	212.942,46	-119.676,48	-0,84%	325.988,52	-400.076,82	217.226,90	-219.005,02
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ECOR3	1.099.196,00	268.579,76	-64.167,38	-0,45%	274.799,00	-274.799,00	161.142,13	-162.461,17
EGE3	3.731.793,00	221.267,65	-50.051,86	-0,35%	671.722,74	-671.722,74	547.080,85	-551.559,01
ELET3	3.159.004,16	357.313,59	226.448,45	1,58%	947.701,25	-947.701,25	463.110,01	-466.900,82
ELET6	3.199.896,00	388.144,36	158.169,05	1,10%	959.968,80	-959.968,80	469.104,75	-472.344,63
ENEV3	1.956.843,00	160.998,10	117.812,25	0,82%	724.031,91	-997.989,93	286.873,18	-289.221,40
ENGH11	2.061.234,00	181.039,67	71.129,32	0,50%	350.404,65	-453.471,48	302.176,90	-304.650,39
EQTL3	3.833.712,00	343.252,14	182.413,27	1,27%	766.728,18	-766.742,40	562.022,18	-566.622,63
GGBR4	4.216.854,60	508.341,64	398.214,74	2,78%	1.054.213,65	-1.054.213,65	618.190,88	-623.251,11
GMAT3	2.120.404,00	406.855,41	339.126,98	2,37%	381.635,65	-339.301,71	130.851,23	-313.395,71
HAPV3	1.297.916,58	872.499,64	665.734,72	4,65%	441.291,63	-441.291,63	190.274,57	-191.832,07
HYPE3	2.009.410,00	223.014,13	184.056,09	1,29%	479.209,64	-411.028,28	294.579,51	-296.990,80
INTB3	1.735.074,00	272.816,14	172.732,90	1,21%	878.922,00	-602.342,40	254.361,85	-256.443,94
ITSA4	3.650.847,24	303.606,39	247.588,80	1,73%	693.660,98	-693.660,98	535.214,21	-539.595,22
ITUB4	15.901.313,38	1.795.137,98	1.440.988,24	10,06%	3.180.262,68	-3.021.249,54	2.331.132,54	-2.350.214,12
JBS3	2.964.885,00	302.910,89	-23.770,23	-0,17%	1.037.709,75	-1.037.709,75	434.652,14	-438.210,00
LREN3	3.977.628,50	384.619,04	275.149,97	1,92%	795.525,70	-795.525,70	583.120,34	-587.893,49
MGLU3	1.014.846,00	328.254,84	244.481,37	1,71%	304.453,80	-304.484,46	148.776,42	-149.994,24
MRVE3	1.134.364,00	310.788,08	-127.826,23	-0,89%	340.309,20	-340.326,98	166.297,76	-167.659,00
MULT3	2.111.648,00	174.670,53	73.464,08	0,51%	645.749,50	-520.841,75	309.567,60	-312.101,57
NTCO3	1.884.960,00	417.223,96	252.320,00	1,76%	471.240,00	-471.240,00	276.335,14	-278.597,09
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	2.060.922,00	300.584,75	222.355,92	1,55%	515.230,50	-618.276,60	302.131,17	-304.604,27
PETRA	16.453.903,55	2.381.233,35	1.848.448,03	12,91%	4.113.475,89	-4.936.171,07	2.412.142,26	-2.431.886,95
PRIO3	3.474.566,00	962.320,67	827.113,62	5,78%	2.084.739,60	-2.084.739,60	509.371,38	-513.540,86
RADL3	4.591.710,00	406.006,76	138.953,74	0,97%	918.323,22	-918.342,00	673.144,69	-678.654,74
RAIL3	3.142.295,00	269.111,53	-30.156,68	-0,21%	1.414.032,75	-1.036.957,35	460.660,45	-464.431,20
RDOR3	2.682.612,00	698.588,30	602.488,03	4,21%	804.783,60	-804.783,60	393.270,92	-396.490,05
RENT3	5.986.140,00	639.433,23	545.041,86	3,81%	1.975.426,20	-1.556.396,40	877.568,12	-884.751,49
SBSP3	2.120.559,00	138.082,48	85.206,89	0,60%	530.139,75	-530.143,94	310.873,95	-313.418,62
STBP3	2.186.716,00	279.286,51	243.999,79	1,70%	765.350,60	-765.350,60	320.572,57	-323.196,63
SUZ3	4.489.640,00	364.829,62	47.766,07	0,33%	1.122.160,00	-897.728,00	658.034,62	-663.420,99
TIMS3	2.827.984,00	330.525,54	-194.422,85	-1,36%	904.954,88	-850.436,32	414.582,45	-417.375,04
TOTS3	3.085.857,28	287.873,18	218.240,45	1,52%	617.171,46	-617.171,46	452.386,68	-456.089,71
VALE3	31.063.799,55	3.148.468,38	2.435.510,79	17,01%	7.765.949,89	-7.765.949,89	4.563.953,01	-4.591.229,57
WEGE3	6.354.185,00	331.838,32	-153.552,46	-1,07%	1.588.546,25	-1.588.546,25	931.523,52	-939.148,54
Total Var:	206.860.273,57	24.924.459,05	14.320.278,16	99,99%	51.962.187,44	-52.450.895,73	29.493.142,14	-29.734.925,93



Data: 31/03/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB III  
CNPJ: 38452993000108

Dados Gerais	
PL:	84.414.027,16
VAR:	7.039.733,90
ETL:	8.828.110,32
VAR / PL:	8,3395%
ETL / PL:	10,4581%
VAR / CDI:	0,0938%
Limite Fundo:	0,00%
Status:	ENQUADRADO
Benchmark:	
Datation DC:	0,00%
Datation DU:	
	3,00
	1,00

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	22.889.395,31	Cenário Baixa - 10000 (+):	833.837,86	CENARIO BRADESCO 1 (+):	11.830.048,09	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.079.260,91
Cenário Alta - 09999 (-):	(820.092,08)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(22.500.774,83)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.074.060,94)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(11.927.114,13)
Cenário Alta - 09999:	22.069.303,23	Cenário Baixa - 10000:	(21.666.936,97)	CENARIO BRADESCO 1:	10.755.987,15	CENARIO BRADESCO 2:	(10.847.853,22)

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALPA4	400.165,00	69.613,39	37.271,26	0,53%	100.041,25	-100.041,25	58.664,19	-58.144,39
ALSO3	4.297.110,40	391.495,09	321.791,12	4,57%	1.503.968,64	-1.074.277,60	629.956,39	-635.112,92
ASAI3	1.002.330,00	169.065,69	136.151,99	1,33%	280.652,40	-260.605,80	146.941,58	-148.144,37
AURE3	2.762.258,31	177.177,08	142.949,02	2,03%	690.564,58	-856.318,91	404.947,07	-408.261,78
BBAS3	1.998.521,00	286.871,63	246.216,95	3,50%	499.630,25	-499.630,25	292.983,18	-295.381,40
BPAC11	4.898.745,00	386.826,84	220.526,18	3,13%	1.469.623,50	-1.714.560,75	718.156,02	-724.034,51
CAIXA	999,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	3.456.433,16	0,00	0,00	0,00%	-96,21	98,11	449,05	-683,44
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	221.391,18	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
DOLK23	36.990,63	336.975,63	219.315,61	3,12%	-819.995,87	833.739,76	-1.074.060,94	1.079.260,91
ELET3	6.764.892,16	765.174,02	505.208,81	7,18%	2.029.467,65	-2.029.467,65	991.733,19	-999.851,06
ENEV3	4.235.764,14	348.494,98	233.535,29	3,32%	1.567.232,73	-2.160.239,71	620.963,02	-626.045,94
ENJ3	204.030,00	69.597,73	3.102,59	0,04%	91.813,50	-55.088,10	29.910,80	-30.155,63
EQTLL3	10.219.754,16	915.027,64	579.687,89	8,23%	2.043.912,93	-2.043.950,83	1.498.215,96	-1.510.479,67
EUCA4	68.400,00	21.777,90	15.490,33	0,22%	54.720,00	-54.720,72	10.027,44	-10.109,52
HAPV3	1.170.354,00	786.748,14	649.205,10	9,22%	397.920,36	-397.920,36	171.573,90	-172.978,32
IGTH1	5.661.750,03	362.995,08	250.721,93	3,56%	1.132.350,01	-1.132.350,01	830.012,55	-836.806,65
ITUB4	5.677.137,28	640.905,85	520.902,75	7,40%	1.135.427,46	-1.078.656,08	832.268,33	-839.080,89
LREN3	2.845.499,82	275.147,22	210.393,05	2,99%	569.099,96	-569.099,96	417.150,27	-420.564,87
LWSA3	167.650,00	39.690,41	182,11	0,00%	67.060,00	-67.060,00	24.577,49	-24.778,67
MIRVE3	199.894,00	54.711,29	-17.363,01	-0,25%	59.908,20	-59.911,33	29.275,14	-29.514,77
NINJ3	242.440,00	38.641,21	29.636,14	0,42%	145.464,00	-145.464,00	35.541,70	-35.832,63
NTCO3	475.530,00	105.255,55	62.413,37	0,89%	118.882,50	-118.882,50	69.712,70	-70.283,33
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETZ3	1.707.480,00	258.193,50	153.962,05	2,19%	426.870,00	-426.870,00	250.316,57	-252.365,54
PRIQ3	1.216.410,00	336.898,62	269.988,08	3,84%	729.846,00	-729.846,00	178.325,71	-179.785,40
RAIZ4	529.815,00	72.795,04	58.573,58	0,83%	185.435,25	-185.435,25	77.670,88	-78.306,66
RDOR3	2.252.714,40	586.637,18	508.861,94	7,23%	675.814,32	-675.814,32	330.247,93	-332.951,19
RECV3	2.229.835,06	796.662,37	489.162,86	6,95%	1.337.901,04	-1.337.901,04	326.893,82	-329.569,62
RENT1	6.420,57	2.354,02	564,45	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	5.797.050,60	619.234,90	568.577,91	8,08%	1.913.025,70	-1.507.233,16	849.847,62	-856.804,08
SCAR3	83.272,00	34.351,45	-17.496,58	-0,25%	49.963,20	-49.963,20	12.207,68	-12.307,60
SOMA3	2.390.122,43	319.400,61	220.215,29	3,13%	717.007,26	-717.066,20	350.391,95	-353.260,10
SUZB3	7.266.521,60	590.611,48	31.510,96	0,45%	1.816.630,40	-1.453.304,32	1.065.272,07	-1.073.991,89
TEND3	171.482,00	48.880,71	-14.741,57	-0,21%	60.018,70	-60.018,70	25.139,26	-25.345,04
VBBR3	3.184.552,36	368.953,13	342.463,83	4,86%	796.138,09	-796.138,09	466.855,38	-470.676,84
YDUQ3	571.755,00	112.583,22	60.752,64	0,86%	222.984,45	-142.938,75	83.819,28	-84.505,39
<b>Total Var:</b>	<b>84.415.271,28</b>	<b>10.386.748,60</b>	<b>7.039.733,90</b>	<b>100,00%</b>	<b>22.069.303,23</b>	<b>-21.666.936,97</b>	<b>10.755.987,15</b>	<b>-10.847.853,22</b>



Data: 31/03/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB IV  
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais			
PL:	79.100.267,22	VAR / PL:	7,8606%
VAR:	6.217.770,51	ETL / PL:	9,8575%
ETL:	7.797.335,07	VAR / CDI:	0,0884%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	3,00
			1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	23.077.871,35	Cenário Baixa - 10000 (+):	191,79	CENARIO BRADESCO 1 (+):	10.524.730,45
Cenário Alta - 09999 (-):	(188,08)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(21.068.784,49)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	23.077.683,27	Cenário Baixa - 10000:	(21.068.592,70)	CENARIO BRADESCO 1:	10.524.730,45
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(10.611.332,07)
				CENARIO BRADESCO 2:	(10.611.332,07)

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
ALSO3	4.840.510,40	441.002,42	375.402,77	6,04%	1.694.178,64	-1.210.127,60	709.618,83	-715.427,44
AURE3	5.615.499,96	360.190,03	275.462,48	4,43%	1.403.874,99	-1.740.843,27	823.232,29	-829.970,89
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	6.757.050,94	0,00	0,00	0,00%	-188,08	191,79	877,86	-1.336,08
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	550.752,09	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
EQTL3	12.376.877,68	1.108.166,11	790.469,64	12,71%	2.475.329,63	-2.475.375,54	1.814.450,27	-1.829.302,52
GGPS3	5.463.936,50	353.387,67	72.318,41	1,16%	2.458.726,27	-2.458.771,43	801.013,09	-807.569,82
GMAT3	5.596.007,56	1.073.741,58	955.330,60	15,36%	1.007.183,53	-895.459,04	820.374,71	-827.089,92
HAPV3	1.074.949,32	722.614,17	570.391,37	9,17%	365.482,77	-365.482,77	157.587,57	-158.877,51
ITUB4	4.453.845,32	502.782,86	383.970,83	6,18%	890.729,06	-846.192,61	652.904,40	-658.248,78
MATD3	1.201.434,65	297.705,53	209.944,26	3,38%	360.430,40	-360.430,40	176.130,32	-177.572,04
MULT3	3.681.807,36	304.550,39	112.189,74	1,80%	1.125.909,84	-908.124,36	539.752,96	-544.171,13
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	7.303.806,35	2.022.817,05	1.649.023,15	26,52%	4.382.163,81	-4.382.163,81	1.070.708,69	-1.079.473,02
RAIL3	7.419.096,10	635.384,10	7.237,79	0,12%	3.338.593,25	-2.448.301,71	1.087.639,49	-1.096.542,40
RENT1	5.291,39	1.940,02	457,48	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	4.819.617,00	514.826,46	485.607,81	7,81%	1.590.473,61	-1.253.100,42	706.555,85	-712.339,39
UGPA3	5.207.680,28	377.503,49	41.522,45	0,67%	1.301.920,07	-1.041.536,06	763.445,93	-769.695,15
YBBR3	2.731.501,96	316.464,00	288.441,71	4,64%	682.875,49	-682.875,49	400.438,19	-403.715,99
<b>Total Var:</b>	<b>79.100.264,86</b>	<b>9.033.075,88</b>	<b>6.217.770,51</b>	<b>100,00%</b>	<b>23.077.683,27</b>	<b>-21.068.592,70</b>	<b>10.524.730,45</b>	<b>-10.611.332,07</b>







Data: 31/03/2023

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais					
PL:	93.151.152,51	VAR / PL:	7,2118%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	6.717.897,62	ETL / PL:	9,0439%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	8.424.514,64	VAR / CDI:	0,0811%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	3,74
				Dutacion DU:	1,51

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	23.731.331,65	Cenário Baixa - 10000 (+):	543,65	CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.546.595,46
Cenário Alta - 09999 (-):	(491,37)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(24.140.493,63)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	23.730.840,28	Cenário Baixa - 10000:	(24.139.949,98)	CENARIO BRADESCO 1:	13.546.595,46
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(13.657.326,82)
				CENARIO BRADESCO 2:	(13.657.326,82)

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
UGPAS	763.095,48	55.316,81	-1.439,17	-0,02%	190.773,97	-152.619,10	111.869,80	-112.785,51
USIMS	188.614,17	25.125,27	17.383,00	0,27%	73.559,53	-41.495,12	27.650,84	-27.877,17
VALES	13.720.356,65	1.390.625,85	1.061.117,15	15,80%	3.430.089,16	-3.430.089,16	2.011.404,29	-2.027.868,71
VBBR3	807.666,09	93.573,88	82.547,19	1,23%	201.916,52	-201.916,52	118.403,85	-119.373,05
VIIA3	149.132,88	27.606,28	18.290,87	0,27%	67.109,80	-67.109,80	21.862,88	-22.041,84
VIVT3	822.298,20	49.432,60	35.772,48	0,53%	123.344,73	-123.344,73	120.548,92	-121.535,67
WEGE3	2.691.303,50	140.549,52	-65.302,88	-0,97%	672.825,88	-672.825,88	394.545,09	-397.774,66
YDUQ3	104.770,05	20.630,08	9.322,98	0,14%	40.860,32	-26.192,51	15.359,29	-15.485,01
<b>Total Var:</b>	<b>93.150.921,10</b>	<b>11.308.719,78</b>	<b>6.717.897,62</b>	<b>99,99%</b>	<b>23.730.840,28</b>	<b>-24.139.949,98</b>	<b>13.546.595,45</b>	<b>-13.657.326,82</b>



### 3. RISCO DE CRÉDITO

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

#### 3.1. Relatório de Risco de Crédito



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/03/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/05/15	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	630.273,27	brAA+	A3.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	630.253,92	brAA+	A3.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	693.284,42	brAA+	A3.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/06/15	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	813.032,36	brAA+	A3.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	12/08/15	16/07/13	16/07/23	DUKE GEP	1.531.911,01	-	Aaa.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.245.348,52	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	460.214,35	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	276.128,61	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	919.610,57	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/17	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	1.487.884,00	brAA+	A3.br	-	
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	18.314.844,58	AAA	Aaa.br	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.583.861,53	-	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	1.046.043,26	-	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.723.573,84	-	-	AAA(bra)	
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.231.058,25	brAAA	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.728.880,05	brAAA	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.407.483,69	brAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	27.357.910,37	-	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	610.578,73	brAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	610.578,73	brAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	610.578,73	brAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	609.229,44	brAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	610.578,73	brAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	12.506.826,59	brAAA	A2.br	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	14.397.191,59	brA	Aa1.br	AA(bra)	
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	12.998.501,77	-	Aa3.br	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	466.468,16	brAA+	A3.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	264.752,20	brAA+	A3.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	699.702,25	brAA+	A3.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	1.287.443,95	brA+	A1.br	AA-(bra)	
FIM EMB II A	14/11/18	14/11/18	15/03/24	BRADESCO	299.093,41	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FIM EMB II A	17/01/19	17/01/19	16/09/24	ITAUUBB	318.673,41	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUUBB	2.528.584,90	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FIM EMB II A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUUBB	2.528.584,90	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	569.423,02	-	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.605.433,31	-	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.053.208,03	-	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.207.532,30	-	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	710.609,10	-	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.749.473,70	-	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.527.309,31	-	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	878.571,26	-	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	622.806,43	-	-	AA(bra)	
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	BCBF	253.407,03	-	-	AA+(bra)	
FIM EMB II A	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.398.516,29	-	-	AA(bra)	
FIM EMB II A	20/01/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	365.408,97	-	Aa1.br	AA(bra)	
FIM EMB II A	20/01/21	31/07/18	23/07/23	COPEL GT	89.742,71	-	-	AA+(bra)	
FIM EMB II A	04/02/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	123.518,52	-	Aa1.br	AA(bra)	
FIM EMB II A	05/02/21	31/07/18	23/07/23	COPEL GT	56.401,50	-	-	AA+(bra)	
FIM EMB II A	05/02/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	169.837,97	-	Aa1.br	AA(bra)	
FIM EMB II A	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	291.377,16	-	-	AA+(bra)	
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.047.673,71	brAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.061.328,68	brAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.208.174,72	brAAA	-	-	
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	606.274,26	brAA+	-	-	
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.026.668,66	brAA+	-	-	
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.742.586,93	brAAA	-	-	
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.339.902,48	brAAA	-	-	
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.573.362,14	brAAA	-	-	
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.621.985,88	brAA	-	-	
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	23.827.857,42	-	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	16/07/13	16/07/23	DUKE GEP	6.146.466,26	-	Aaa.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	467.486,25	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	822.775,80	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	934.972,50	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	467.486,25	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	572.203,17	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	481.060,07	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.395.725,54	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	13.388.867,84	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	6.195.564,88	brAAA	-	AA(bra)	



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/03/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	4.129.276,64	brAA	A2.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	1.345.439,19	brAAA	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.590.158,85	-	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.838.707,78	-	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.144.134,21	-	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADERCO	4.332.896,00	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FIM EMB I A	28/05/21	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	1.181.372,96	-	Aa1.br	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	174.834,56	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	245.100,00	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.585.210,19	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	120.000,00	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	3.169.873,30	brA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	990.968,93	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	56.250,00	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.327.544,17	brAA	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.002.805,25	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	296.356,65	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.581.019,29	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.662.413,76	-	-	A(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	671.560,61	-	-	A(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	28.575,92	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	441.375,78	-	-	AA	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	771.549,79	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	BCBF	515.187,40	-	-	AA+(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	BCBF	515.187,40	-	-	AA+(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	441.891,56	-	-	AA-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	898.153,57	-	-	AA-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	884.681,27	-	-	AA-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	1.792.632,59	-	-	AA	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	447.636,43	-	-	AA	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	192.887,45	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	482.728,90	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	BCBF	1.544.502,14	-	-	AA+(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	595.214,10	brAAA	AAbr	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	903.077,67	brAAA	AAbr	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SFB COME	496.500,74	brA+	-	A+(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SFB COME	1.188.804,59	brA+	-	A+(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	60.900,00	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	14/07/20	13/07/23	ECORODOV	2.071.515,55	brAAA	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.732.056,10	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	747.177,68	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	767.674,88	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	526.460,92	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/21	23/09/20	15/04/28	PAMPASUL	1.183.053,69	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	36.750,00	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.465.762,62	-	-	A(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	190.500,00	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	80.112,53	-	-	A(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.476.020,67	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.967.130,82	-	-	A(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	06/12/19	15/10/26	LIGHT	2.774.717,11	BB-	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.595.250,42	-	-	A(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.114.308,96	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	235.660,60	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.150.211,27	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	247.967,00	brAA+	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.621.387,25	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	4.919.980,20	brAA+	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADERCO	3.776.613,71	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.030.573,53	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	217.738,75	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	986.278,57	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	219.300,00	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	512.864,86	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	193.500,00	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	283.800,00	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	141.900,00	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.832.008,78	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	286.385,45	-	-	AA-(bra)	



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/03/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.061.147,06	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	368.612,45	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	368.612,45	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.314.183,50	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	2.341.901,49	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	28/06/18	15/05/23	ELEKTRO	572.335,69	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.754.179,94	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	617.125,41	brAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.891.743,29	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	242.700,00	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.914.483,29	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	701.527,51	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB I A	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.324.356,39	-	Aa2.br	-	
FIM EMB I A	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.279.354,70	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.125.804,28	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	875.554,36	-	-	AA-(bra)	
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.025.074,25	brAA+	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.579.382,76	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.454.827,81	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.151.296,03	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.049.596,48	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.029.335,40	A	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.139.310,30	brAA	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	998.934,25	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.295.056,92	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	3.183.364,37	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.155.409,25	brAA	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	896.587,67	brAA	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	982.276,11	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/09/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	517.389,32	-	-	AA(bra)	
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	655.112,76	-	-	AA(bra)	
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	58.666,81	-	-	AA(bra)	
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	293.334,07	-	-	AA(bra)	
FIM EMB I A	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	2.281.009,37	-	-	AA(bra)	
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.064.488,52	brAAA	-	-	
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	744.821,71	brAAA	-	-	
FIM EMB I A	17/09/21	04/10/18	01/10/24	EQUATENE	1.490.750,89	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/09/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	1.412.372,36	brA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	986.381,74	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.052.921,84	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.052.921,84	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.034.410,96	brAA+	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	767.932,61	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	767.932,61	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	255.285,71	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	255.285,71	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	772.956,14	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	772.956,14	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	993.255,01	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	385.841,37	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	385.841,37	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.913.940,44	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.966.496,52	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	05/04/21	15/03/24	CCPR	40.149,72	-	A.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	31/05/21	20/05/25	CEA MODA	1.659.643,78	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	09/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.211.930,97	brAAA	AAAbr	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	28/12/20	15/01/26	LOCAMERI	1.856.283,42	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	2.251.605,11	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	817.111,85	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	611.760,09	brAA	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.136.228,30	-	-	AA-(bra)	
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.477.684,42	brAA+	AA.br	AA(bra)	
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.383.398,13	brAA+	AA.br	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.587.254,10	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	796.874,26	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	990.824,97	-	-	A+(bra)	
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.202.069,24	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	801.014,17	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.160.674,84	brAAA	-	-	



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/03/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB I A	28/10/21	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.630.527,15	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.079.901,18	A	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	318.289,29	-	-	CC
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.097.536,29	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/11/21	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	3.974.632,38	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.662.890,20	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.200.441,86	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.163.091,13	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	804.946,05	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBBM	596.090,87	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.491.059,65	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.434.417,88	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.069.779,92	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	972.607,55	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.249.656,30	brAA	-	-
FIM EMB I A	19/01/22	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.181.676,50	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	328.072,11	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.965.239,54	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	331.168,52	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	320.819,51	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.917.324,40	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/02/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.121.891,84	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	765.827,21	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	683.035,08	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/03/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.954.992,98	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/03/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	3.329.671,73	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	992.620,96	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/04/22	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	864.662,91	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	1.196.031,25	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/24	LIGHT	934.877,56	-	-	CC
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	2.588.120,65	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.276.842,44	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.969.754,59	-	At.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.530.579,76	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/05/22	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	525.186,72	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.413.598,92	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.310.740,22	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	552.046,84	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.177.159,92	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.737.609,68	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.548.575,04	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.050.388,85	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.039.042,36	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.432.536,20	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	775.257,00	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	28/04/21	15/03/28	BRISANET	479.994,21	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	441.637,47	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	486.268,49	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	253.435,14	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	1.758.940,77	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	844.268,60	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	68.879,72	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	728.329,59	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	823.592,68	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/06/22	23/09/20	15/04/28	PAMPASUL	2.613.044,59	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.197.463,21	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.224.250,24	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/07/22	18/10/21	15/09/46	ENGIE	47.819,29	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/07/22	18/10/21	15/09/46	ENGIE	2.809.861,21	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.936.245,40	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.028.317,59	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.520.713,81	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/07/22	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	1.637.606,86	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	10/01/22	10/01/28	AMBIPAR	2.368.344,11	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	03/05/21	26/04/26	GGSH PAR	2.419.190,39	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.672.299,40	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	V11	1.659.501,19	brAAA(sf)	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.510.051,12	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	19/10/21	15/10/36	UHESIMAO	1.584.945,36	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.184,06	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	503.712,24	-	-	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/03/2023

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	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.421.715,85	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.368.824,85	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.613.908,93	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	791.519,22	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/08/22	23/08/22	15/08/32	PETRJ	5.706.365,81	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	8.897.376,02	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.652.927,54	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	50.914,38	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.560.182,48	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/10/22	06/10/22	13/09/32	NTRASSUD	1.675.984,80	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	35.521,66	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	2.047.543,26	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	4.283.337,69	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/11/22	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	1.047.770,35	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	4.438.367,70	-	AA-br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.503.664,12	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.453.834,93	A	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.708.992,23	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	10.045.978,20	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.705.083,39	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.667.847,21	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.365.619,86	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.249.249,50	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.520.698,57	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.245.357,75	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.571.742,48	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.005.213,99	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.127.216,09	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.551.616,44	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	16/11/20	15/10/36	PAMPASUL	2.292.292,16	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.048.402,67	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/22	20/12/22	16/12/29	CSMG	1.967.783,04	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	2.911.492,08	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.740.115,05	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.953.408,60	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	3.160.531,87	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	26/01/23	20/01/26	BCBF	481.265,60	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	AESTUCAN	1.007.727,99	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	ITAPOA T	3.047.891,60	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	BRV_VDR	7.791.644,63	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	PETRJ	4.064.309,86	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/03/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	997.731,39	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN3	2.117.416,26	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN4	8.122,48	-	-	AAAsf(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.522.763,75	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	408.807,68	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN6	1.401.680,80	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.501.736,64	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	757.774,24	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	3.218.630,82	-	-	Aasf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.833.805,04	-	-	AAAsf(bra)

Observação: Em março de 2023, quatro ativos da carteira de crédito da EMBRAER PREV sofreram rebaixamentos de suas classificações de risco: o rating de LIGHB4 e LIGHD3 (Light SESA) foi revisado pela Fitch de CCC para Fitch CC, portanto, abaixo da classificação mínima de crédito estabelecida pela Política de Investimentos do Plano Embraer Prev, enquanto que o rating de GUAR15 (Guararapes) foi revisado pela Fitch de A+ para Fitch A e de UNEG11 (UTE GNA) foi alterado de S&P de AA para S&P A, ambos mantendo-se acima dessa classificação mínima de crédito. Os gestores dos fundos de investimento em que estão alocados esses ativos acompanham atentamente a evolução dessas classificações, sob o monitoramento do administrador desses fundos e da Entidade, visando ao seu enquadramento aos limites estabelecidos na Política de Investimento.





#### 4. RISCO OPERACIONAL

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

#### 5. RISCO DE LIQUIDEZ

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

#### 6. RISCO LEGAL

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

##### 6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



### Relatório Resumo de Enquadramento

**Patrimônio Líquido da Fundação** **4.260.217.384,36**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.698.551.358,73	4.260.217.384,36	86,82%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.022.551.089,78	4.260.217.384,36	70,95%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	676.000.268,95	3.408.173.958,27	15,87%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	852.043.489,57	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	426.021.744,78	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.065.054.346,09	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.065.054.346,09	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	466.516.694,95	2.982.152.118,27	10,95%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.065.054.346,09	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	65.394.596,67	852.043.489,57	1,54%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	26.617.928,80	639.032.633,05	0,62%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	852.043.489,57	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	426.021.744,78	0,00%	Enquadrado

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

## 6.2. Relatório de Túnel de Preços

### RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV  
Período: 01 DE MARÇO DE 2023 À 31 DE MARÇO DE 2023



FIM EMB I A		FONTE ANBIMA										
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
02/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,2013%	4,5030%	3,4456%	6,4685%	-0,3017%	NÃO
02/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,2013%	4,5030%	3,4456%	6,4685%	-0,3017%	NÃO
02/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,3011%	4,5030%	3,4456%	6,4685%	-0,2019%	NÃO
02/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,3011%	4,5030%	3,4456%	6,4685%	-0,2019%	NÃO
02/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,1515%	4,5030%	3,4456%	6,4685%	-0,3515%	NÃO
02/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,2013%	4,5030%	3,4456%	6,4685%	-0,3017%	NÃO
03/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,4995%	4,2313%	3,4783%	6,5236%	0,2682%	NÃO
06/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,2515%	4,1331%	3,1984%	6,2663%	0,1184%	NÃO
06/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,3511%	4,1331%	3,1984%	6,2663%	0,2180%	NÃO
06/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,3013%	4,1331%	3,1984%	6,2663%	0,1682%	NÃO
08/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,2010%	4,3150%	3,3130%	6,4265%	-0,1140%	NÃO
08/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,1012%	4,3150%	3,3130%	6,4265%	-0,2138%	NÃO
08/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,1012%	4,3150%	3,3130%	6,4265%	-0,2138%	NÃO
08/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,2010%	4,3150%	3,3130%	6,4265%	-0,1140%	NÃO
08/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,2513%	4,3150%	3,3130%	6,4265%	-0,0637%	NÃO
08/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,2513%	4,3150%	3,3130%	6,4265%	-0,0637%	NÃO
08/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,2010%	4,3150%	3,3130%	6,4265%	-0,1140%	NÃO
08/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,2010%	4,3150%	3,3130%	6,4265%	-0,1140%	NÃO
09/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,3494%	4,2618%	3,2625%	6,3991%	0,0876%	NÃO
09/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,3991%	4,2618%	3,2625%	6,3991%	0,1373%	NÃO
14/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,5994%	4,5385%	3,5154%	6,7222%	0,0609%	NÃO
14/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,5994%	4,5385%	3,5154%	6,7222%	0,0609%	NÃO
14/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,8994%	4,5385%	3,5154%	6,7222%	0,3609%	NÃO
14/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,6491%	4,5385%	3,5154%	6,7222%	0,1106%	NÃO
14/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,5994%	4,5385%	3,5154%	6,7222%	0,0609%	NÃO



RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE MARÇO DE 2023 À 31 DE MARÇO DE 2023



FIM EMB I A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FONTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
14/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,5994%	4,5385%	3,5154%	6,7222%	0,0609%	NÃO
14/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,6491%	4,5385%	3,5154%	6,7222%	0,1106%	NÃO
14/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,5994%	4,5385%	3,5154%	6,7222%	0,0609%	NÃO
14/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,5994%	4,5385%	3,5154%	6,7222%	0,0609%	NÃO
14/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,6995%	4,5385%	3,5154%	6,7222%	0,1610%	NÃO
14/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,5994%	4,5385%	3,5154%	6,7222%	0,0609%	NÃO
16/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,7992%	4,5993%	3,7552%	7,0095%	0,1999%	NÃO
16/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,7992%	4,5993%	3,7552%	7,0095%	0,1999%	NÃO
16/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	4,7992%	4,5993%	3,7552%	7,0095%	0,1999%	NÃO
20/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,7010%	4,7040%	3,5975%	6,9000%	-0,0030%	NÃO
20/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,7010%	4,7040%	3,5975%	6,9000%	-0,0030%	NÃO
20/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,7010%	4,7040%	3,5975%	6,9000%	-0,0030%	NÃO
20/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,7114%	4,6894%	3,5952%	6,9220%	0,0220%	NÃO
21/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,7114%	4,6894%	3,5952%	6,9220%	0,0220%	NÃO
21/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,7114%	4,6894%	3,5952%	6,9220%	0,0220%	NÃO
21/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,7114%	4,6894%	3,5952%	6,9220%	0,0220%	NÃO
21/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,7114%	4,6894%	3,5952%	6,9220%	0,0220%	NÃO
22/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,6516%	4,7938%	3,5722%	6,9235%	-0,1422%	NÃO
22/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,6516%	4,7938%	3,5722%	6,9235%	-0,1422%	NÃO
22/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,6516%	4,7938%	3,5722%	6,9235%	-0,1422%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,8511%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,6552%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,1011%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,4052%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,9514%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,5549%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,9514%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,5549%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,0015%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,5048%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,9012%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,6051%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,8511%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,6552%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,8511%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,6552%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,1011%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,4052%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,8511%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,6552%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,0015%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,5048%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,0015%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,5048%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,8011%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,7052%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,8011%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,7052%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,0015%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,5048%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,9514%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,5549%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,0015%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,5048%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,0015%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,5048%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,0015%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,5048%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,9012%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,6051%	NÃO
24/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	4,9012%	5,5063%	3,8686%	7,2695%	-0,6051%	NÃO
27/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,4512%	5,7001%	4,3727%	7,7986%	-0,2489%	NÃO
27/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,4017%	5,7001%	4,3727%	7,7986%	-0,2984%	NÃO
27/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,4512%	5,7001%	4,3727%	7,7986%	-0,2489%	NÃO
27/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,4017%	5,7001%	4,3727%	7,7986%	-0,2984%	NÃO
27/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,4512%	5,7001%	4,3727%	7,7986%	-0,2489%	NÃO
27/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,4512%	5,7001%	4,3727%	7,7986%	-0,2489%	NÃO
27/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,4017%	5,7001%	4,3727%	7,7986%	-0,2984%	NÃO
27/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,4512%	5,7001%	4,3727%	7,7986%	-0,2489%	NÃO
27/03/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,4512%	5,7001%	4,3727%	7,7986%	-0,2489%	NÃO



RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV  
Período: 01 DE MARÇO DE 2023 À 31 DE MARÇO DE 2023



FIM EMB II A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
08/03/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2024	Compra	0,0051%	0,0060%	-0,0223%	0,0217%	-0,0009%	NÃO
09/03/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	LTN	01/07/2023	Venda	13,5710%	13,5569%	13,4531%	13,9586%	0,0141%	NÃO
16/03/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,6834%	5,7231%	5,4080%	6,0080%	-0,0397%	NÃO
31/03/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	5,7010%	5,7924%	5,4229%	6,1126%	-0,0914%	NÃO
31/03/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2025	Venda	5,6910%	5,7924%	5,4229%	6,1126%	-0,1014%	NÃO
31/03/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2025	Venda	5,7010%	5,7924%	5,4229%	6,1126%	-0,0914%	NÃO
31/03/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	5,7010%	5,7924%	5,4229%	6,1126%	-0,0914%	NÃO
31/03/2023	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/05/2025	Venda	5,7010%	5,7924%	5,4229%	6,1126%	-0,0914%	NÃO
31/03/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2025	Venda	5,7010%	5,7924%	5,4229%	6,1126%	-0,0914%	NÃO
31/03/2023	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,6790%	5,7502%	5,4006%	6,0030%	-0,0712%	NÃO
31/03/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,6721%	5,7502%	5,4006%	6,0030%	-0,0781%	NÃO
31/03/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Venda	5,6810%	5,7411%	5,3762%	5,9603%	-0,0601%	NÃO
31/03/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Venda	5,6810%	5,7411%	5,3762%	5,9603%	-0,0601%	NÃO
31/03/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Venda	5,6810%	5,7411%	5,3762%	5,9603%	-0,0601%	NÃO
31/03/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,8890%	5,9258%	5,5772%	6,1322%	-0,0368%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV  
Período: 01 DE MARÇO DE 2023 À 31 DE MARÇO DE 2023



FIM EMB VI A CRED PRIV												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
17/03/2023	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	GENIAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,4090%	6,3675%	6,2029%	6,5585%	0,0415%	NÃO

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE MARÇO DE 2023 À 31 DE MARÇO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBovespa				VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO		
01-03-23	FIA RVA EMB II	Compra	CSMG3	15,19	50.700,00	769.997,00	14,74	15,02	15,45	11.258,00	
01-03-23	FIA RVA EMB II	Compra	GGBR4	29,12	11.600,00	337.797,60	28,50	29,38	29,95	50.811,00	
01-03-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	28,15	41.200,00	1.159.840,00	27,38	28,08	28,87	45.314,00	
01-03-23	FIA RVA EMB II	Venda	RRRP3	33,27	27.100,00	901.750,49	30,91	32,56	36,41	69.634,00	
01-03-23	FIA RVA EMB II	Compra	WEGE3	39,70	22.000,00	873.292,00	38,69	39,36	39,88	29.840,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	16,23	2.300,00	37.335,99	16,02	16,31	17,13	21.377,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,57	16.500,00	240.449,95	14,45	14,60	14,88	20.294,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,59	7.300,00	106.482,77	14,45	14,60	14,88	20.294,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	10,44	15.800,00	164.966,73	10,33	10,45	10,67	57.276,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,13	7.900,00	261.740,38	32,93	33,34	34,33	37.126,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,36	1.900,00	63.384,73	32,93	33,34	34,33	37.126,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	24,90	3.800,00	94.618,29	24,69	24,92	25,52	32.527,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	24,97	8.000,00	199.727,04	24,69	24,92	25,52	32.527,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	24,85	2.100,00	52.185,00	24,69	24,92	25,52	32.527,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	18,45	2.100,00	38.743,11	18,10	18,46	19,56	33.248,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,52	10.900,00	158.279,89	14,24	14,51	15,45	43.702,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,53	2.200,00	16.566,00	7,38	7,51	7,65	3.894,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,49	4.400,00	32.965,70	7,38	7,51	7,65	3.894,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,33	5.200,00	32.916,66	6,27	6,36	6,60	15.815,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	32,39	2.000,00	64.780,64	31,44	32,40	33,96	94.236,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	26,72	4.900,00	130.943,00	26,25	26,67	28,32	32.709,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	52,93	1.700,00	89.980,50	52,60	53,40	55,41	35.100,00	
01-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	46,69	1.400,00	65.368,42	45,76	46,69	48,43	34.793,00	
01-03-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ALSO3	16,17	15.524,00	251.006,91	16,02	16,31	17,13	21.377,00	
01-03-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	GALG11	8,35	5.612,00	46.860,21	8,34	8,39	8,60	2.175,00	
01-03-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM11	78,49	3.684,00	289.142,50	76,44	78,65	79,87	3.952,00	
01-03-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PATC11	65,64	8.696,00	570.772,93	63,80	65,80	67,74	198,00	
01-03-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	103,07	14.162,00	1.459.735,58	102,71	103,12	104,99	3.970,00	
02-03-23	FIA RVA EMB II	Compra	CCRO3	10,85	97.800,00	1.061.259,00	10,75	10,83	10,95	10.641,00	
02-03-23	FIA RVA EMB II	Compra	ELET6	35,38	12.200,00	431.691,83	34,80	35,35	35,96	6.936,00	
02-03-23	FIA RVA EMB II	Compra	EQTL3	25,27	7.100,00	179.425,79	24,92	25,13	25,43	28.666,00	
02-03-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	3,04	246.600,00	749.250,47	2,84	2,98	3,15	82.490,00	
02-03-23	FIA RVA EMB II	Compra	JBSS3	19,32	15.400,00	297.493,51	18,80	19,26	19,59	25.212,00	
02-03-23	FIA RVA EMB II	Compra	LWSA3	4,59	95.400,00	438.079,00	4,41	4,60	4,70	12.813,00	
02-03-23	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	14,23	16.600,00	236.141,82	14,06	14,30	14,65	36.000,00	
02-03-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	28,42	38.000,00	1.079.872,90	27,78	28,39	29,18	34.693,00	
02-03-23	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	34,88	18.600,00	648.680,19	33,50	34,62	35,33	67.452,00	
02-03-23	FIA RVA EMB II	Venda	RRRP3	33,32	23.400,00	779.613,98	31,22	32,72	33,89	47.970,00	





















RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE MARÇO DE 2023 À 31 DE MARÇO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
31-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	41,94	1.500,00	62.903,02	41,60	42,04	43,61	40.349,00
31-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	42,10	300,00	12.630,21	41,60	42,04	43,61	40.349,00
31-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,34	300,00	4.300,76	14,12	14,34	14,54	27.787,00
31-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,42	500,00	7.209,26	14,12	14,34	14,54	27.787,00
31-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,33	1.700,00	24.369,12	14,12	14,34	14,54	27.787,00
31-03-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,33	300,00	4.299,34	14,12	14,34	14,54	27.787,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	27,07	6.798,00	184.021,86	26,80	27,07	27,55	29.310,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,94	7.145,00	192.456,18	26,80	27,07	27,55	29.310,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	27,33	2.679,00	73.228,51	26,80	27,07	27,55	29.310,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,96	3.572,00	96.301,12	26,80	27,07	27,55	29.310,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	27,47	2.106,00	57.852,71	26,80	27,07	27,55	29.310,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	27,11	484,00	13.120,72	26,80	27,07	27,55	29.310,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,80	29.977,00	173.808,89	5,58	5,78	5,97	26.913,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	2,62	30.762,00	80.640,35	2,57	2,65	2,84	58.303,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	2,64	12.305,00	32.512,81	2,57	2,65	2,84	58.303,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	2,68	6.152,00	16.464,09	2,57	2,65	2,84	58.303,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	24,98	15.459,00	386.223,40	24,49	24,85	25,09	69.255,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	31,43	5.100,00	160.290,00	31,16	31,53	32,50	32.310,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	13,85	11.600,00	160.654,00	13,61	13,89	14,04	17.690,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,44	16.313,00	235.545,10	14,12	14,34	14,54	27.787,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,28	16.218,00	231.668,93	14,12	14,34	14,54	27.787,00
31-03-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,41	6.134,00	88.390,94	14,12	14,34	14,54	27.787,00

## 7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

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

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

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



## 8. GLOSSÁRIO

### **Administrador**

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

### **Carteira**

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

### **Dados Gerais**

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

### **Duration**

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

Vide também glossário de Valor Presente.

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

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

### **Fundo de Investimento**

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

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

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



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

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

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

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

### ***Patrimônio de Cobertura***

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

### ***Patrimônio Líquido (PL)***

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

### ***Rating***

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

### ***Stress Testing***

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

### ***Tracking Error***

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



### **Túnel de Preços**

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

### **Valor Presente**

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

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

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