



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Julho/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: 31/07/2023

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	4.497.739.372,43	VAR / PL:	1,4826%
VAR:	66.681.881,52	ETL / PL:	1,8592%
ETL:	83.621.769,61	VAR / CDI:	0,0167%
Limite Fundo:	ENQUADRADO	0,00% Dutation DC:	1.822,01
Status:		Dutation DU:	1.253,56
Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	206.130.883,32	Cenário Baixa - 10000 (+):	320.239.414,48	CENARIO BRADESCO 1 (+):	408.880.669,64	CENARIO BRADESCO 2 (+):	48.739.690,31
Cenário Alta - 09999 (-):	(221.757.197,91)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(223.611.167,03)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(90.798.571,13)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(401.269.192,90)
Cenário Alta - 09999:	(15.626.314,60)	Cenário Baixa - 10000:	96.628.247,45	CENARIO BRADESCO 1:	318.082.098,51	CENARIO BRADESCO 2:	(352.529.502,59)

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
VVEO16	1.088.738,26	226,39	182,60	0,00%	-1.705,26	1.401,26	2.050,40	-2.904,99
WDOQ23	-1.143,30	0,00	0,00	0,00%	-56.756,66	56.795,28	-69.297,79	69.868,47
WDOU23	-90,70	42.692,46	26.397,08	0,04%	-142.771,21	145.091,62	-184.522,58	185.411,90
WEGE3	7.110.191,12	867.379,88	-426.441,19	-0,64%	1.777.547,78	-1.777.547,78	1.042.354,02	-1.050.886,25
WINQ23	6.448,60	27.447,13	24.178,68	0,04%	84.082,71	-84.026,00	67.512,21	-67.962,97
XPIN11	3.477.811,30	160.739,90	59.958,68	0,09%	1.738.905,65	-1.738.905,65	509.847,14	-514.020,51
XPPR11	2.027.762,40	63.364,03	-10.803,69	-0,02%	1.013.891,20	-1.013.891,20	297.274,90	-299.706,24
YDUQ3	1.624.995,89	475.899,14	440.702,13	0,66%	633.748,40	-406.248,97	238.224,40	-240.174,39
Total Var:	4.775.778.493,79	135.617.787,53	66.681.881,52	99,99%	-15.626.314,60	96.628.247,46	318.082.098,51	-352.529.502,60



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/07/2023

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	3.262.866.179,68	VAR / PL:	1,1826%
VAR:	38.588.032,57	ETL / PL:	1,4831%
ETL:	48.390.949,63	VAR / CDI:	0,0133%
Limite Fundo:	ENQUADRADO	0,00% Dutation DC:	2.387,11
Status:		Dutation DU:	1.642,20
Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	275.362.654,80	CENARIO BRADESCO 1 (+):	221.242.095,33	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(195.117.371,24)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(250.613.129,46)
Cenário Alta - 09999:	(195.117.371,24)	Cenário Baixa - 10000:	275.362.654,80	CENARIO BRADESCO 1:	221.242.095,33	CENARIO BRADESCO 2:	(250.613.129,46)

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
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	2.791.465.489,26	37.928.294,87	37.671.937,68	97,63%	-154.167.859,68	257.972.009,97	172.789.062,32	-196.893.597,24
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	143.085.258,68	810.814,10	-574.386,33	-1,49%	-6.523.090,42	786.866,76	2.232.231,29	-2.944.914,23
FIM EMB VI A CRED PRIV	256.554.651,84	1.846.573,82	-1.154.922,79	-2,99%	-6.590.806,82	5.109.134,39	32.143.909,68	-32.931.712,63
FIM EMB VII A CRED PRIV	348.597.339,79	4.110.459,85	2.645.404,91	6,86%	-27.835.614,32	11.494.643,69	14.076.892,04	-17.842.905,37
Total Var:	3.538.702.735,57	44.696.142,64	38.588.032,57	100,01%	-195.117.371,24	275.362.654,80	221.242.095,33	-250.613.129,46

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JULHO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/07/2023

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	594.672.093,30	VAR / PL:	5,2705%
VAR:	31.336.897,85	ETL / PL:	6,6094%
ETL:	39.297.734,14	VAR / CDI:	0,0593%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
0,00% Duration DC:		0,00% Duration DU:	
Benchmark:			

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	151.091.314,38	Cenário Baixa - 10000 (+):	0,51
Cenário Alta - 09999 (-):	(0,50)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(149.724.362,51)
Cenário Alta - 09999:	151.091.313,89	Cenário Baixa - 10000:	(149.724.362,00)

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

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA RVA EMB II	246.241.256,40	14.025.643,67	13.970.864,22	44,58%	62.988.960,87	-63.830.098,49	34.946.077,01	-35.232.427,22
FIA RVA EMB III	108.230.674,90	5.927.249,79	5.842.535,09	18,64%	28.774.294,16	-28.656.129,22	13.911.433,83	-14.029.911,43
FIA RVA EMB IV	101.208.681,13	3.802.687,56	3.279.531,19	10,47%	30.453.760,89	-28.072.174,59	13.751.523,64	-13.864.578,98
FIC FIA EMB VIII ETF	27.437.269,50	1.609.305,40	1.587.433,67	5,07%	-0,50	0,51	2,32	-3,53
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	111.453.638,70	6.710.714,50	6.656.533,69	21,24%	28.874.298,47	-29.165.960,20	16.219.017,85	-16.350.805,32
Total Var:	594.571.520,63	32.075.600,91	31.336.897,85	100,00%	151.091.313,89	-149.724.362,00	78.828.054,65	-79.477.726,47



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/07/2023

FUNDO: FI RF EMB II
CNPJ: 11005764000196

Dados Gerais			
PL:	2.594.011.981,90	VAR / PL:	1,4621%
VAR:	37.928.162,24	ETL / PL:	1,8336%
ETL:	47.563.445,61	VAR / CDI:	0,0164%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
0,00% Duration DC:		0,00% Duration DU:	
Benchmark:			

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	258.099.988,58
Cenário Alta - 09999 (-):	(154.167.320,59)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(128.880,69)
Cenário Alta - 09999:	(154.167.320,59)	Cenário Baixa - 10000:	257.971.107,88

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

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CSMGC3	10.623.279,97	71.386,13	-60.731,12	-0,16%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET42	14.366.094,66	65.850,65	45.133,28	0,12%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENTV12	14.040.947,43	82.017,28	55.226,24	0,15%	-18.307,84	18.668,98	85.450,53	-130.053,22
GASP17	49.879.855,48	1.654.228,71	-1.296.068,82	-3,42%	0,00	0,00	0,00	0,00
IGSN15	2.890.679,02	28.354,65	16.160,99	0,04%	-352.178,81	-32.750,31	85.866,33	-115.350,99
NEOE16	7.185.279,93	36.363,51	26.225,68	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	123.682.174,63	1.279.904,23	-1.090.368,52	-2,87%	-944.366,23	299.114,00	407.652,34	-533.308,08
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	43.244.391,48	278.947,14	-183.111,49	-0,48%	-984.812,51	306.059,49	430.977,58	-560.455,76
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	27.434.158,25	214.639,43	192.559,30	0,51%	-1.545.888,36	1.896.860,95	1.314.783,56	-1.723.575,44
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	245.615.801,70	3.963.166,06	3.781.979,35	9,97%	-206.075,49	81.719,87	101.954,75	-130.291,75
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	31.128.299,49	608.005,77	605.219,72	1,60%	-487.038,13	163.993,92	215.124,85	-281.151,75
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	235.890.731,08	5.437.877,63	5.429.236,75	14,31%	-1.763.201,79	1.825.819,21	1.237.450,53	-1.659.016,90
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	760.580.733,70	19.924.735,67	19.881.397,13	52,42%	-1.265.197,94	1.387.755,68	922.973,54	-1.219.930,57
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	237.640.492,03	6.783.451,45	6.764.053,61	17,83%	-1.494.544,58	1.704.991,07	1.198.879,86	-1.537.095,01
PETRA5	18.957.772,36	84.187,35	-68.057,25	-0,18%	-17.997.182,93	23.917.629,30	16.935.750,29	-20.918.102,89
SBSPO2	9.625.559,35	64.406,86	-55.899,91	-0,15%	-2.691.261,24	4.009.454,61	2.795.765,05	-3.324.553,31
BBTOPIND	301.236.496,05	3.906.779,02	3.868.198,31	10,24%	-21.233.879,27	39.263.337,77	25.231.033,88	-29.093.721,88
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-75.934.371,56	137.695.590,50	90.663.132,32	-101.494.643,64
COMPROMISSADA_PRE	657.729.194,19	0,00	0,00	0,00%	-26.617.616,10	45.508.993,24	31.022.811,01	-33.984.842,03
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-61.212,80	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-340.439,74	-61.103,18	69.993,24	-94.245,54
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-290.958,09	-35.027,20	68.838,48	-92.570,01
Total Var:	2.791.455.727,99	44.484.301,53	37.928.162,24	100,00%	-154.167.320,59	257.971.107,88	172.788.458,11	-196.892.908,73

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JULHO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/07/2023

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais					
PL:	137.431.444,51	VAR / PL:	0,5900%	Limite Fundo:	0,00% Dutation DC:
VAR:	810.814,10	ETL / PL:	0,7399%	Status:	ENQUADRADO Dutation DU:
ETL:	1.016.793,60	VAR / CDI:	0,0066%	Benchmark:	

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	1.167.071,67	CENARIO BRADESCO 1 (+):	2.232.231,29	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(6.523.090,41)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(380.204,91)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(2.944.914,22)
Cenário Alta - 09999:	(6.523.090,41)	Cenário Baixa - 10000:	786.866,76	CENARIO BRADESCO 1:	2.232.231,29	CENARIO BRADESCO 2:	(2.944.914,22)

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
17H0164854	8.290.901,56	33.991,10	32.345,18	3,99%	-375.367,34	9.805,84	110.039,42	-146.323,81
AEGP23	14.390.556,25	102.618,21	97.645,39	12,04%	-546.205,79	-32.444,10	138.245,89	-185.444,04
CCRDD1	6.264.905,97	37.565,63	35.168,68	4,34%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	1.384.877,07	9.262,70	8.790,11	1,08%	-151.750,92	-19.618,53	35.668,28	-48.019,00
ENJG21	1.865.360,18	8.495,30	8.176,88	1,01%	-41.946,29	-5.066,08	9.914,63	-13.332,51
ENMIZ1	1.170.474,93	5.190,95	4.960,05	0,61%	-16,67	16,99	77,78	-118,39
ENTV12	18.457.995,48	107.818,55	-27.646,11	-3,41%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	12.588.593,94	89.325,56	85.286,00	10,52%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	4.296.822,55	25.628,57	23.972,49	2,96%	-83.298,33	788,56	23.794,01	-31.685,85
GASP17	10.319.970,10	342.254,22	300.273,92	37,03%	-53.946,76	632,81	15.448,01	-20.563,61
GRRB24_VENCIMENTO	15.641.039,58	78.035,42	-15.212,11	-1,88%	-1.294.618,11	402.340,70	566.555,94	-736.765,80
LFSN16000GM	14.432.300,59	90.017,22	80.840,31	9,97%	-459.144,66	-33.580,02	114.449,09	-153.611,19
LFSN18000DC5	4.758.683,95	32.871,47	29.665,39	3,66%	-103.334,07	-13.523,92	24.256,01	-32.656,11
OMGE31	12.777.701,20	62.653,30	55.892,10	6,89%	-319.838,97	392.453,99	272.024,19	-356.601,82
SBSPC2	7.376.649,33	49.358,88	46.839,31	5,78%	-1.048.636,91	361.032,78	466.527,70	-609.926,85
TAEES3	8.491.835,72	47.370,18	43.816,51	5,40%	-677.189,73	-130.653,97	130.982,61	-175.868,75
CAKA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-255.403,66	-37.574,74	56.458,17	-74.239,62
COMPROMISSADA_PRE	598.720,45	0,00	0,00	0,00%	-703.726,76	-55.433,08	172.881,64	-230.699,48
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-23.129,20	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-222.978,81	-26.843,47	52.755,10	-70.942,00
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-185.687,66	-25.467,01	43.152,82	-58.115,41
Total Var:	143.085.258,64	1.122.457,47	810.814,10	99,99%	-6.523.090,41	786.866,76	2.232.231,29	-2.944.914,22



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/07/2023

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

Dados Gerais							
PL:	244.282.698,85	VAR / PL:	0,7559%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	671,30
VAR:	1.846.573,82	ETL / PL:	0,9480%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	461,95
ETL:	2.315.678,07	VAR / CDI:	0,0085%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	887.498,16	Cenário Baixa - 10000 (+):	7.518.203,78	CENARIO BRADESCO 1 (+):	39.816.510,16	CENARIO BRADESCO 2 (+):	2.828.890,32
Cenário Alta - 09999 (-):	(7.478.304,98)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(2.409.069,39)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(7.672.600,49)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(35.760.602,95)
Cenário Alta - 09999:	(6.590.806,82)	Cenário Baixa - 10000:	5.109.134,39	CENARIO BRADESCO 1:	32.143.909,68	CENARIO BRADESCO 2:	(32.931.712,63)

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
SNGO18	1.980.847,26	87,69	58,09	0,00%	-721,02	587,40	1.024,84	-1.503,96
UGEL11	1.107.377,60	135,38	0,42	0,00%	-1.216,93	992,03	1.525,09	-2.191,32
UNEG11	4.602.724,54	114.702,56	-10.438,35	-0,57%	-467.924,69	286.757,79	292.880,84	-361.558,81
VAMQ33	2.797.406,49	28.367,17	-4.131,42	-0,22%	-229.265,60	83.659,84	108.277,67	-139.651,91
VCCS11	1.076.803,20	799,31	-389,40	-0,02%	-4.417,06	3.738,98	5.276,76	-7.175,73
VECS11	3.508.464,04	151,99	102,26	0,01%	-1.186,11	957,03	1.632,76	-2.395,13
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	2.129.854,31	121,06	58,47	0,00%	-1.112,99	902,06	1.505,60	-2.196,85
VVEO15	1.576.015,72	277,00	-53,40	0,00%	-2.212,57	1.808,03	2.656,75	-3.781,04
VVED16	1.088.738,26	226,39	-62,10	0,00%	-1.705,26	1.401,26	2.050,40	-2.904,99
Total Var:	255.554.651,83	2.970.630,72	1.846.573,82	100,01%	-6.590.806,82	5.109.134,39	32.143.909,68	-32.931.712,63

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JULHO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/07/2023

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

Dados Gerais					
PL:	287.129.815,66	VAR / PL:	1,4295%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	4.104.609,39	ETL / PL:	1,7927%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	5.147.345,77	VAR / CDI:	0,0161%	Benchmark:	Dutacion DU: 2.102,20
					1.446,23

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	11.547.555,44	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.056.856,27
Cenário Alta - 09999 (-):	(27.795.995,62)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(69.272,19)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	(27.795.995,62)	Cenário Baixa - 10000:	11.478.283,25	CENARIO BRADESCO 1:	14.056.856,27
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(17.817.509,39)
				CENARIO BRADESCO 2:	(17.817.509,39)

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
ANEM11	13.036.794,90	239.823,32	238.149,22	5,80%	-1.171.001,64	622.019,11	678.371,65	-242.244,97
ANET11	2.432.992,42	7.618,89	-406,76	0,01%	-120.069,77	15.870,92	41.488,93	-54.721,83
ASAB11	6.539.205,69	50.036,19	49.506,50	1,21%	-451.973,42	161.819,36	212.989,18	-274.048,93
BRKP28	9.293.221,50	178.294,98	177.085,83	4,31%	-861.526,49	443.511,71	487.224,57	-615.608,75
BRST11	6.899.988,37	23.876,93	-1.360,53	-0,03%	-391.899,68	28.821,91	123.218,14	-163.118,63
BTOW15	5.295.764,58	90.722,04	89.761,69	2,19%	-535.339,79	214.289,34	266.280,96	-341.086,10
CAEC21	9.000.377,73	34.865,47	18.273,87	0,45%	-567.622,10	149.448,54	229.773,86	-301.496,80
CAIXA	999,95	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	9.931.314,92	124.659,84	124.531,63	3,03%	-812.574,63	355.137,40	419.501,75	-534.031,22
CBAN32	9.942.546,14	128.761,62	128.277,72	3,13%	-833.777,36	370.461,97	432.913,64	-552.451,21
CBAN72	4.673.770,72	66.072,97	65.830,35	1,60%	-402.219,49	185.152,61	212.799,08	-271.022,23
CJEM13	4.750.084,47	58.696,61	58.672,84	1,43%	-382.428,54	167.528,27	197.837,21	-251.416,34
CNRD11	10.286.617,56	164.611,61	164.139,77	4,00%	-894.838,54	448.490,73	495.282,87	-625.614,33
COMPROMISSADA_PRE	949.777,04	0,00	0,00	0,00%	-23,65	24,12	110,40	-168,03
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-137.873,12	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	10.288.906,53	39.187,48	24.519,49	0,60%	-648.171,49	160.522,80	259.301,42	-339.730,33
CREDZM24	633.916,13	90.765,87	39.258,32	0,96%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	8.350.857,03	38.582,16	34.474,17	0,84%	-543.161,75	133.300,78	221.510,05	-288.380,51
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	6.604.815,62	46.866,15	-17.766,47	-0,43%	-240.897,90	-17.618,32	60.047,62	-80.594,67
ERDV38	5.791.747,93	30.175,48	-8.691,32	-0,21%	-308.825,05	-31.704,13	72.681,72	-97.098,35
GBSP11	5.143.177,65	144.780,73	142.653,69	3,48%	-659.479,69	346.278,65	357.500,78	-432.392,22
GRRB24	8.240.840,99	41.114,76	27.422,89	0,67%	-352.497,91	190.218,41	245.800,83	-321.353,97
HARG11	10.785.309,74	173.734,45	173.069,12	4,22%	-814.855,69	467.460,31	514.011,38	-645.231,25
HBSA21	7.797.978,60	88.738,38	87.968,39	2,14%	-655.681,55	245.585,52	314.654,99	-404.739,27
HVRD15	10.897.867,51	175.263,26	174.174,04	4,24%	-991.021,92	494.673,66	543.408,50	-688.990,36
IPIL11	9.166.230,93	83.184,60	82.858,62	2,02%	-669.175,31	253.349,92	323.545,61	-413.493,19
IRBR12	11.441.482,87	45.915,02	-8.115,54	-0,20%	-653.705,14	6.761,07	185.536,19	-246.702,35
ITPO14	8.308.608,25	166.592,80	165.659,90	4,04%	-804.197,92	439.842,46	466.557,24	-585.702,97
LAMEA6	9.079.826,92	94.269,56	93.490,12	2,28%	-745.290,66	249.369,75	342.492,66	-441.429,70
LCAMD1	7.797.917,18	84.305,32	83.447,22	2,03%	-644.764,79	236.175,71	306.303,50	-394.343,77
LORTA7	6.461.445,29	73.169,71	72.425,96	1,76%	-548.444,31	198.180,73	259.307,42	-333.881,49
MOV137	8.827.977,90	91.215,96	90.272,71	2,20%	-717.583,25	298.431,08	338.412,55	-436.905,01
MTRJ19	8.972.488,76	45.608,78	42.431,63	1,03%	-579.616,11	164.496,41	247.864,74	-321.906,48
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	6.714.804,52	21.793,69	11.514,43	0,28%	-389.549,15	77.321,90	147.970,43	-193.933,65
QUAT12	3.981.523,99	22.227,02	-6.520,78	-0,16%	-211.779,15	-19.949,74	50.705,54	-67.758,97
RAHD11	13.255.060,39	244.050,53	242.450,45	5,91%	-1.193.559,51	626.708,56	688.375,48	-854.279,80
RDVE11	4.161.074,59	58.046,92	57.946,21	1,41%	-350.952,71	155.249,81	184.036,68	-231.866,49
RMSA12	11.132.654,13	345.817,93	341.101,21	8,31%	-1.302.897,85	823.404,10	839.164,05	-1.022.253,69
RSAN44	7.416.794,25	32.940,44	28.522,98	0,69%	-492.057,31	111.486,76	194.984,04	-254.241,39
TCH11	13.937.426,39	288.926,91	286.574,17	6,99%	-1.337.881,55	731.427,80	790.609,09	-974.778,49
UNEG11	5.564.868,41	138.679,74	137.176,20	3,34%	-665.738,68	346.701,04	354.104,04	-437.138,30
UTPS21	6.664.098,90	122.105,96	121.520,69	2,96%	-605.434,95	320.878,57	346.258,06	-435.250,43
UTPS22	6.397.984,14	125.622,69	124.866,08	3,04%	-597.850,73	326.743,13	347.608,90	-436.297,31
VAMO33	8.610.182,45	87.311,77	85.924,93	2,09%	-705.660,27	257.497,98	333.259,58	-429.836,85
VAMO34	7.280.201,22	77.506,23	76.832,68	1,87%	-597.077,22	218.123,50	283.416,93	-364.842,15
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	3.432.151,46	15.861,18	12.737,45	0,31%	-227.828,26	65.049,02	95.888,04	-125.205,84
VIMT13	7.197.142,96	111.563,77	111.293,57	2,71%	-611.923,93	304.272,05	338.225,49	-426.468,80
VRDN12	4.998.327,50	60.710,82	60.634,25	1,48%	-403.139,01	175.468,01	207.490,47	-264.451,97
Total Var:	348.101.173,88	4.474.475,92	4.104.609,39	100,00%	-27.795.995,62	11.478.283,25	14.056.856,27	-17.817.509,39

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JULHO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/07/2023

FUNDO: FIM EMB II A
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais							
PL:	191.752.087,39	VAR / PL:	0,2587%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	567,79
VAR:	496.103,40	ETL / PL:	0,3244%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	391,29
ETL:	622.133,68	VAR / CDI:	0,0029%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	3.001.441,34	Cenário Baixa - 10000 (+):	4.735.513,41	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.643.712,37	CENARIO BRADESCO 2 (+):	2.569.619,38
Cenário Alta - 09999 (-):	(4.050.881,28)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(3.420.647,53)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(3.669.153,50)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(6.299.982,35)
Cenário Alta - 09999:	(1.049.439,94)	Cenário Baixa - 10000:	1.314.865,88	CENARIO BRADESCO 1:	2.984.558,88	CENARIO BRADESCO 2:	(3.730.362,97)

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
CAXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA PRE	7.245.507,52	0,00	0,00	0,00%	-201,68	205,66	941,32	-1.432,66
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-18.670,63	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT16	144.063,09	35,95	-21,04	0,00%	232,56	-183,48	-320,72	481,21
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF24	55,02	653,34	150,29	0,03%	-2.841,96	2.577,56	6.049,96	-9.064,02
DHF25	5.426,13	43.753,77	33.164,87	6,69%	-368.966,89	292.506,11	453.845,27	-659.644,49
DHF26	4.738,44	36.922,98	18.245,76	3,68%	-238.474,19	194.220,50	267.628,55	-377.973,69
DHF27	441,81	3.363,75	1.161,54	0,23%	-16.712,50	14.026,63	19.018,14	-26.033,42
DHF29	436,29	3.399,14	859,53	0,17%	-14.107,76	12.443,54	17.284,94	-22.121,20
DHF33	498,60	4.364,68	936,79	0,19%	-15.421,00	14.565,90	21.360,13	-23.851,70
DHJ24	71,69	1.045,58	417,41	0,08%	-5.358,59	4.498,24	8.940,54	-13.286,38
DHJ25	54,39	361,50	264,75	0,05%	-3.080,24	2.463,19	3.657,47	-5.279,40
DHJ25	-10.405,90	83.054,40	-54.624,49	-11,01%	667.320,75	-536.046,18	-770.022,53	1.103.928,61
DHJ26	-19.657,70	140.050,12	-56.218,03	-11,33%	763.132,00	-634.524,76	-858.193,88	1.193.964,31
DHV23	4,55	39,84	-0,03	0,00%	-154,09	156,96	542,53	-820,12
DHV24	95,45	831,24	589,53	0,12%	-6.504,44	5.125,17	8.388,38	-12.279,10
ERDV18	1.385.034,45	4,20	0,15	0,00%	-17,11	17,38	54,00	-81,51
IDIF24P381200	-92.670,46	137.783,60	-31.694,49	-6,39%	92.670,46	-772.804,56	-1.852.927,95	92.670,46
IDIF24P381300	122.212,04	155.375,88	35.741,26	7,20%	-122.212,04	782.307,83	1.862.714,57	-122.212,04
INDQ23	106.911,00	455.044,58	321.403,28	64,79%	1.394.002,87	-1.393.062,55	1.119.281,39	-1.126.754,47
LFT20230901 - 210100	43.006.342,68	536,33	-13,72	0,00%	-8.673,06	9.341,61	501,94	-764,17
LFT20240301 - 210100	8.392.152,30	430,53	120,31	0,02%	-11.273,16	13.530,74	95,80	-145,85
LFT20240901 - 210100	23.247.026,31	3.110,71	1.243,38	0,25%	-72.758,09	94.713,52	556,25	-846,85
LFT20250901 - 210100	9.610.574,24	3.532,91	1.243,52	0,25%	-55.650,27	84.165,39	1.065,67	-1.622,22
LFT20260301 - 210100	13.553.854,12	7.061,37	2.574,23	0,52%	-78.196,94	167.826,11	6.772,87	-10.304,99
LFT20260901 - 210100	1.801.216,00	1.468,41	480,02	0,10%	-11.683,77	27.430,86	1.263,53	-1.921,99
LTN20250701 - 100000	16.417.038,49	89.319,77	58.011,48	11,69%	-678.361,42	575.673,59	806.186,61	-1.155.388,24
LTN20260701 - 100000	11.678.554,31	145.172,16	61.636,40	12,42%	-733.819,65	682.107,14	877.280,27	-1.219.233,72
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	13.632.699,76	141.075,71	11.570,62	2,33%	-194.346,52	201.248,44	136.396,30	-182.862,89
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	10.619.576,47	118.450,89	13.662,41	2,75%	-221.434,39	217.826,10	153.100,95	-204.201,09
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	14.945.261,70	96.404,13	13.882,28	2,80%	-437.252,41	479.606,36	318.979,65	-421.608,00
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	6.115.208,94	26.617,76	4.591,01	0,93%	-206.026,83	247.003,64	160.266,99	-210.596,00
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	9.811.380,05	40.050,98	10.186,22	2,05%	-409.869,01	470.205,41	324.026,15	-421.689,04
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOU23	-87,34	41.111,26	27.151,96	5,47%	-137.483,38	139.717,86	-177.688,42	178.544,79
WINQ23	6.448,60	27.447,13	19.386,23	3,91%	84.082,71	-84.026,00	67.512,21	-67.962,97
Total Var:	191.720.192,50	1.807.874,59	496.103,40	99,99%	-1.049.439,94	1.314.865,88	2.984.558,88	-3.730.362,97

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JULHO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/07/2023

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais								
PL:	66.682.329,14	VAR / PL:	2,6652%	Limite Fundo:		0,00%	Dutacion DC:	1,00
VAR:	1.777.196,97	ETL / PL:	3,3422%	Status:	ENQUADRADO		Dutacion DU:	
ETL:	2.228.676,70	VAR / CDI:	0,03%	Benchmark:				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	36.260.342,17	Cenário Baixa - 10000 (-):	2,04	CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.777.617,88	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(2,00)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(36.260.342,17)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.849.472,21)
Cenário Alta - 09999:	36.260.340,17	Cenário Baixa - 10000:	(36.260.340,13)	CENARIO BRADESCO 1:	8.777.617,88	CENARIO BRADESCO 2:	(8.849.472,21)

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

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	2.593.338,95	173.175,20	107.959,13	6,07%	1.296.669,48	-1.296.669,48	380.163,49	-383.295,50
BMLC11	3.190.260,74	167.494,15	-82.654,02	-4,65%	3.190.260,74	-3.190.260,74	467.692,22	-471.520,54
BPML11	1.365.268,76	116.306,85	7.871,91	0,44%	1.365.268,76	-1.365.268,76	200.148,40	-201.786,72
BTLG11	3.116.822,30	65.645,88	-18.244,80	-1,03%	1.558.411,15	-1.558.411,15	456.926,15	-460.666,34
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	911.995,70	44.585,14	2.925,28	0,16%	455.997,85	-455.997,85	133.698,57	-134.792,96
CNES11	437.504,10	35.741,22	-13.257,04	-0,75%	218.752,05	-218.752,05	64.138,10	-64.663,11
COMPROMISSADA_PRE	71.839,45	0,00	0,00	0,00%	-2,00	2,04	9,33	-14,21
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-195.070,81	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FVPQ11	1.234.069,90	109.929,48	11.776,91	0,66%	617.034,95	-617.034,95	180.914,65	-182.395,53
GALG11	1.900.399,97	87.663,95	78.242,89	4,40%	950.199,99	-950.199,99	278.598,64	-280.879,12
GTLG11	935.090,00	254.665,61	177.217,62	9,97%	935.090,00	-935.090,00	137.064,19	-138.206,30
HBRH11	2.759.065,81	106.478,90	29.150,92	1,64%	2.759.065,81	-2.759.065,81	404.479,05	-407.789,93
HSLG11	931.443,87	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
MALL11	4.416.720,00	216.401,48	190.874,77	10,74%	2.208.360,00	-2.208.360,00	647.491,15	-652.791,22
MAXR11	1.373.641,00	62.714,38	-19.595,71	-1,10%	686.820,50	-686.820,50	201.375,77	-203.024,14
NEWL11	1.512.480,00	83.302,75	-20.064,96	-1,13%	756.240,00	-756.240,00	221.729,57	-223.544,54
NEWU11	896.043,60	39.390,10	-4.715,63	-0,27%	896.043,60	-896.043,60	131.359,99	-132.435,24
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	5.964.588,90	526.826,31	420.008,03	23,63%	2.982.279,45	-2.982.279,45	874.404,34	-881.561,81
QAGR11	5.319.172,80	152.084,92	127.813,32	7,19%	2.659.586,40	-2.659.586,40	779.790,73	-786.173,74
RBRL11	3.600.408,70	257.536,05	201.651,25	11,35%	3.600.408,70	-3.600.408,70	513.159,92	-517.360,41
RCRB11	6.086.748,99	426.320,08	292.323,99	16,45%	0,00	0,00	0,00	0,00
RNGO11	39.757,80	1.664,34	795,87	0,04%	19.878,90	-19.878,90	5.828,49	-5.876,20
TEPP11	5.359.008,60	316.022,67	259.453,22	14,60%	2.679.504,30	-2.679.504,30	785.630,66	-792.061,47
TRXF11	7.543.345,40	413.795,92	-121.167,99	-8,82%	3.771.672,70	-3.771.672,70	1.105.854,44	-1.114.906,45
TRXF13	55.296,50	3.086,59	-896,22	-0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
XPIN11	3.477.811,30	160.739,90	139.308,58	7,84%	1.738.905,65	-1.738.905,65	509.847,14	-514.020,51
XPPR11	2.027.782,40	63.364,03	10.410,73	0,59%	1.013.891,20	-1.013.891,20	297.272,90	-299.706,24
Total Var:	66.825.804,73	3.886.935,91	1.777.196,97	99,97%	36.260.340,17	-36.260.340,13	8.777.617,88	-8.849.472,21

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JULHO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/07/2023

FUNDO:	FIA RVA EMB III
CNPJ:	38452593000108

Dados Gerais					
PL:	108.230.673,14	VAR / PL:	5,4765%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	5.927.249,79	ETL / PL:	6,8677%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	7.433.010,36	VAR / CD:	0,0616%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	1,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	29.742.130,52	Cenário Baixa - 10000 (+):	983.566,85	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.162.086,90
Cenário Alta - 09999 (-):	(967.836,35)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(29.639.696,07)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.250.653,07)
Cenário Alta - 09999:	28.774.294,16	Cenário Baixa - 10000:	(28.656.129,22)	CENARIO BRADESCO 1:	13.911.433,83
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.256.680,64
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(15.286.592,07)
				CENARIO BRADESCO 2:	(14.029.911,43)

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
ALSO3	2.860.168,74	348.067,51	283.462,61	4,73%	1.001.059,06	-715.042,19	419.300,74	-422.732,94
ASAI3	2.412.477,00	477.502,77	217.700,99	3,67%	675.493,56	-627.244,02	353.659,13	-356.564,10
AURE3	4.195.702,00	268.722,00	196.427,66	3,31%	1.048.925,50	-1.300.667,62	615.089,91	-620.124,76
BBAS3	4.124.292,96	694.795,40	578.131,22	9,75%	1.031.073,24	-1.031.073,24	604.621,35	-609.570,50
BBSE3	3.171.128,00	212.938,09	-127.091,24	-2,14%	634.225,60	-634.225,60	464.887,37	-468.692,72
BPAC11	4.047.938,22	274.229,77	214.222,91	3,61%	1.214.381,47	-1.416.778,38	593.427,74	-598.285,27
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	2.179.224,00	248.016,08	-132.583,61	-2,24%	653.767,20	-544.806,00	319.474,24	-322.089,31
COMPROMISSADA_PRE	5.922.448,47	0,00	0,00	0,00%	-164,85	168,10	769,43	-1.171,05
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-1.111.786,88	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
DOLLU23	-604,64	284.616,39	175.589,63	2,96%	-951.808,03	967.277,46	-1.230.150,56	1.236.079,32
ELET3	7.306.975,75	741.006,31	667.782,99	11,80%	2.192.092,73	-2.192.111,63	1.071.202,65	-1.079.971,02
ENEV3	6.050.753,94	342.019,31	-9.754,82	-0,16%	2.238.778,96	-3.085.884,51	887.040,63	-934.301,43
ENJU3	196.690,00	44.100,84	11.597,15	0,20%	88.510,50	-53.117,87	28.834,75	-29.070,78
EQTL3	10.962.381,30	623.069,24	-68.731,84	-1,16%	2.192.476,26	-2.192.476,26	1.607.085,10	-1.620.239,96
FLRY3	670.176,00	56.980,62	37.068,08	0,63%	134.031,04	-134.035,20	98.247,80	-99.052,01
HAPV3	1.172.308,80	262.950,09	205.093,72	3,46%	398.584,99	-398.609,42	171.860,47	-173.267,24
IGTH11	6.680.117,16	599.097,55	491.478,67	8,29%	1.335.992,90	-1.336.023,43	979.305,18	-987.321,32
ITUB4	9.483.448,64	650.372,31	539.185,83	9,10%	1.896.689,73	-1.801.855,24	1.390.273,57	-1.401.653,71
ITREN3	4.654.237,50	1.204.113,12	1.083.082,73	18,27%	930.847,50	-930.847,50	682.311,22	-687.896,30
LWSA3	132.927,99	58.265,94	50.264,80	0,85%	53.169,40	-53.171,20	19.487,24	-19.646,76
NINJ3	400.303,00	67.353,04	31.287,98	0,53%	240.181,80	-240.181,80	58.664,42	-59.164,76
NTCO3	2.970.756,81	501.934,09	402.296,99	6,73%	742.689,20	-742.689,20	435.512,95	-439.077,66
ONCO3	961.996,00	206.998,41	55.662,55	0,94%	336.698,60	-336.698,60	141.028,61	-142.183,01
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	3.179.714,00	530.553,43	-383.138,67	-6,46%	1.907.828,40	-1.907.828,40	466.146,07	-469.961,73
RECV3	3.794.706,41	767.272,02	-316.477,59	-5,34%	2.276.823,85	-2.276.823,85	556.303,96	-560.857,61
RENT3	5.797.926,66	462.024,21	288.747,67	4,87%	1.913.315,80	-1.507.469,56	849.976,05	-856.933,56
SCAR3	158.720,00	15.976,20	-4.511,16	-0,08%	95.232,00	-95.232,00	23.268,35	-23.458,82
SMFT3	3.234.690,00	349.534,33	306.853,15	5,18%	1.293.876,00	-1.293.876,00	474.205,55	-478.087,18
SOMA3	338.470,12	75.946,23	68.236,30	1,15%	101.541,04	-101.541,04	49.619,72	-50.025,88
SUZB3	8.489.498,49	929.033,55	584.383,38	9,86%	2.122.374,62	-1.697.899,70	1.244.560,48	-1.254.747,88
VBR3	2.921.650,54	450.996,73	380.466,07	6,42%	730.397,58	-730.414,64	428.315,14	-431.621,13
WVAS3	870.240,00	92.312,17	77.589,15	1,31%	261.072,00	-261.072,00	127.571,18	-128.621,47
WDOU23	-10,08	4.743,61	2.926,49	0,05%	-15.863,47	16.121,29	-20.502,51	20.601,32
Total Var:	108.230.674,90	11.845.541,34	5.927.249,79	100,00%	28.774.294,16	-28.656.129,22	13.911.433,83	-14.029.911,43

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JULHO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/07/2023

FUNDO:	FIA RVA EMB IV
CNPJ:	38452613000132

Dados Gerais			
PL:	101.208.683,69	VAR / PL:	3,7573%
VAR:	3.802.687,56	ETL / PL:	4,7118%
ETL:	4.768.723,61	VAR / CDI:	0,0422%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutation DC:	0,00%
		Dutation DU:	1,00

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	30.453.965,93	Cenário Baixa - 10000 (+):	209,09
Cenário Alta - 09999 (-):	(205,04)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(28.072.383,68)
Cenário Alta - 09999:	30.453.760,89	Cenário Baixa - 10000:	(28.072.174,59)
CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.751.523,64	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
CENARIO BRADESCO 2 (+):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(13.864.578,98)
CENARIO BRADESCO 1:	13.751.523,64	CENARIO BRADESCO 2:	(13.864.578,98)

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
ALSO3	3.829.851,54	466.048,47	352.528,14	9,27%	1.340.378,04	-997.412,89	561.426,92	-566.022,50
AURE3	4.340.392,00	277.988,95	159.889,17	4,20%	1.085.098,00	-1.345.521,52	636.301,47	-641.509,94
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	7.366.401,91	0,00	0,00	0,00%	-205,04	209,09	957,02	-1.456,56
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	44.781,15	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
ENGI11	3.459.245,37	223.197,00	37.203,00	0,98%	588.071,71	-761.033,98	507.125,37	-511.276,47
EQTL3	12.592.224,06	715.704,67	-96.958,59	-2,55%	2.518.444,81	-2.518.444,81	1.846.020,05	-1.861.130,72
GGPS3	7.450.592,94	459.374,59	382.779,73	10,07%	3.352.724,08	-3.352.766,82	1.092.256,93	-1.101.197,64
GMAT3	6.144.328,08	1.008.323,37	876.627,81	23,05%	1.105.901,47	-983.092,49	900.758,50	-908.131,69
HAPV3	3.179.044,80	713.963,09	578.517,20	15,21%	1.080.875,23	-1.080.941,46	466.047,97	-469.862,82
ITUB4	7.698.632,48	527.970,11	373.310,77	9,82%	1.539.726,50	-1.462.740,17	1.128.619,52	-1.137.857,88
MATD3	1.573.343,72	234.556,22	198.615,88	15,22%	472.003,12	-472.018,42	230.652,19	-232.540,20
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	10.822.569,46	1.805.807,50	-1.107.919,14	-29,14%	6.493.541,68	-6.493.541,68	1.586.588,68	-1.599.575,77
RAIL3	10.595.092,76	690.838,34	317.434,44	8,35%	4.767.791,74	-3.496.380,61	1.553.240,60	-1.565.954,71
RENT3	7.269.977,44	579.328,74	442.741,03	11,64%	2.399.092,56	-1.890.204,95	1.065.778,69	-1.074.502,67
UGPA3	9.041.339,59	732.495,20	482.037,11	12,68%	2.260.334,90	-1.808.267,92	1.325.460,38	-1.336.309,99
VBBR3	5.800.063,83	895.316,74	805.881,01	21,19%	1.449.982,10	-1.450.015,96	850.289,36	-857.249,43
Total Var:	101.208.681,13	9.330.012,98	3.802.687,56	99,99%	30.453.760,89	-28.072.174,59	13.751.523,64	-13.864.578,98



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/07/2023

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

Dados Gerais					
PL:	111.454.217,27	VAR / PL:	6,0211%	Limite Fundo:	0,00% Dutation DC:
VAR:	6.710.714,50	ETL / PL:	7,5506%	Status:	ENQUADRADO Dutation DU:
ETL:	8.415.506,72	VAR / CDI:	0,0677%	Benchmark:	

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	28.874.788,77	Cenário Baixa - 10000 (+):	544,53	CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.219.017,85
Cenário Alta - 09999 (-):	(490,30)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(29.166.504,73)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	28.874.298,46	Cenário Baixa - 10000:	(29.165.960,20)	CENARIO BRADESCO 2 (+):	(16.350.805,31)
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(16.350.805,31)

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
TIMS3	573.012,06	53.626,14	45.332,79	0,68%	183.363,86	-131.792,77	84.003,57	-84.691,18
TOTS3	751.048,43	48.808,43	34.275,75	0,51%	156.302,91	-146.145,85	110.103,70	-111.004,96
UGPA3	1.015.734,19	82.290,95	26.875,93	0,40%	253.333,55	-203.146,84	148.906,63	-150.125,51
USIM5	184.046,88	10.850,51	1.816,27	0,83%	71.778,28	-40.490,31	26.881,27	-27.202,13
VALE3	13.793.408,72	1.723.643,29	-526.631,98	-7,85%	3.448.332,24	-3.448.352,18	2.022.113,72	-2.038.665,81
VBRR3	943.588,92	145.655,46	116.325,77	1,73%	235.891,72	-235.897,23	138.330,14	-139.462,44
VIII3	168.860,16	53.476,54	46.188,19	0,69%	75.987,07	-75.987,07	24.754,90	-24.957,53
VIVT3	880.604,32	76.010,51	69.367,98	1,03%	132.090,65	-132.090,65	129.096,59	-130.153,32
WEGE3	2.487.455,12	303.447,33	-104.109,30	-1,55%	621.863,78	-621.863,78	364.660,92	-367.645,87
YDUQ3	324.661,89	95.081,05	82.113,56	1,22%	126.618,14	-81.165,47	47.595,43	-47.985,03
Total Var:	111.453.638,69	13.158.202,72	6.710.714,50	99,99%	28.874.298,47	-29.165.960,20	16.219.017,85	-16.350.805,32

3. RISCO DE CRÉDITO

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

3.1. Relatório de Risco de Crédito

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JULHO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/07/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.293.654,42	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	478.411,10	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	287.046,66	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	956.247,67	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	18.860.713,40	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.415.436,04	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	996.905,10	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.546.046,85	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.510.902,08	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.902.553,72	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.851.918,51	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	25.751.741,24	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	632.621,45	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	632.621,45	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	632.621,45	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	631.318,67	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	632.621,45	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	12.053.004,69	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	13.902.192,23	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	10.402.411,97	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	1.336.618,19	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUBB	2.655.212,22	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	553.772,99	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.506.341,50	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	1.996.777,62	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.036.924,34	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	698.126,63	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.648.479,16	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.377.519,65	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	863.138,39	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	605.689,21	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	266.455,53	-	-	AAA(bra)
FIM EMB II A	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.368.636,29	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	142.875,84	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.252.703,21	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.265.863,35	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.235.672,14	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	598.877,78	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	5.953.144,04	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.753.973,49	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.361.724,28	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.596.709,29	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.594.995,77	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.428.935,91	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	483.509,07	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	850.975,96	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	967.018,14	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	483.509,07	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	591.815,10	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	498.323,25	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.445.812,14	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	13.865.715,87	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	6.204.395,24	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	4.254.457,58	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	1.386.226,80	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	9.968.415,96	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.782.446,80	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.115.993,52	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	4.487.629,41	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	28/05/21	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	1.234.219,00	-	Aa1.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	177.229,05	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	294.120,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.596.385,31	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	144.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	3.351.154,47	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.060.317,12	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	67.500,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.413.682,17	brAA	-	AA-(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/07/2023

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	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.602.672,50	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.088.552,81	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	715.411,04	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	30.008,34	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	431.958,58	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	810.225,27	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	505.128,94	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	505.128,94	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	386.684,71	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	785.944,53	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	774.155,36	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	1.754.384,97	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	438.085,65	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	202.556,32	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	506.926,66	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.514.347,47	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	588.832,37	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	892.799,28	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SBF COME	240.246,12	brA+	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SBF COME	575.237,19	brA+	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	73.080,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	392.869,41	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	809.691,75	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	805.128,35	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	533.719,97	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	44.100,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.561.471,52	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	228.600,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	85.343,58	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.430.885,06	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.160.873,51	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.764.710,70	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.170.276,20	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	247.496,88	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.259.929,16	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	260.335,38	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.871.439,64	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.165.384,52	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.004.682,11	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.039.351,12	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	220.720,84	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	990.541,97	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	263.160,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	515.081,83	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	232.200,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	340.560,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	170.280,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.857.099,47	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	290.307,70	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.078.702,24	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	386.699,62	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	386.699,62	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.378.668,22	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	863.039,12	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.984.613,74	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	602.535,44	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	-	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	291.240,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	2.048.459,19	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	750.620,53	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.292.007,66	-	Aa2.br	-
FIM EMB I A	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.342.767,00	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.101.157,42	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	925.853,08	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.087.486,10	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.601.159,92	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.030.663,37	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.094.641,81	brAA+	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/07/2023

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	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.407.629,57	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	-	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.602.672,50	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.088.552,81	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	715.411,04	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	30.008,34	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	431.958,58	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	810.225,27	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	505.128,94	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	505.128,94	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	386.684,71	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	785.944,53	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	774.155,36	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	1.754.384,97	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	438.085,65	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	202.556,32	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	506.926,66	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.514.347,47	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	588.832,37	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	892.799,28	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SBF COME	240.246,12	brA+	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SBF COME	575.237,19	brA+	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	73.080,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	392.869,41	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	809.691,75	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	805.128,35	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	533.719,97	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	44.100,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.561.471,52	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	228.600,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	85.343,58	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.430.885,06	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.160.873,51	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.764.710,70	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.170.276,20	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	247.496,88	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.259.929,16	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	260.335,38	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.871.439,64	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.165.384,52	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.004.682,11	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.039.351,12	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	220.720,84	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	990.541,97	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	263.160,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	515.081,83	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	232.200,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	340.560,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	170.280,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.857.099,47	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	290.307,70	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.078.702,24	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	386.699,62	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	386.699,62	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.378.668,22	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	863.039,12	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.984.613,74	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	602.535,44	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	-	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	291.240,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	2.048.459,19	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	750.620,53	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.292.007,66	-	Aa2.br	-
FIM EMB I A	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.342.767,00	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.101.157,42	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	925.853,08	-	-	AA-(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JULHO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/07/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.087.486,10	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.601.159,92	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.030.663,37	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.094.641,81	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	-	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	370.527,66	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	936.300,69	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.058.467,37	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.189.086,54	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	3.067.350,87	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.230.378,24	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	954.762,96	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.054.541,86	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/09/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	-	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	649.778,28	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	58.189,10	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	290.945,50	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	1.111.730,88	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.024.144,27	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	639.318,01	brAAA	-	-
FIM EMB I A	17/09/21	04/10/18	01/10/24	EQUATENE	1.457.435,02	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/09/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	1.493.144,20	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.071.014,45	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.067.439,94	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.067.439,94	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.119.596,74	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	832.183,18	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	832.183,18	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	276.644,68	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	276.644,68	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	756.528,02	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	756.528,02	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	972.144,74	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	377.640,84	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	377.640,84	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.238.023,89	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.294.931,73	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	05/04/21	15/03/24	CCPR	42.124,22	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	09/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.266.857,02	brAAA	AAAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/21	28/12/20	15/01/26	LOCAMERI	1.821.030,74	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	2.349.306,17	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	886.269,24	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	651.454,29	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.871.375,47	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.611.892,41	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.454.266,42	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.329.236,13	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	874.883,81	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	1.033.367,78	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.070.621,02	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.283.604,56	brAAA	-	-
FIM EMB I A	28/10/21	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.742.649,30	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.352.393,07	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	343.771,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.208.512,84	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/11/21	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	4.149.581,93	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.795.142,13	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.153.674,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.335.124,73	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	850.979,93	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBBM	589.306,45	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.686.655,63	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.489.504,55	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.177.554,59	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	1.014.368,17	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.220.112,14	brAA	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/07/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB I A	19/01/22	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.237.171,56	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	358.180,25	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.135.972,52	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	363.588,08	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	352.225,95	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	4.073.184,78	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	840.797,43	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	749.900,41	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/03/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.296.226,25	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.071.565,46	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/04/22	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	506.712,88	BB-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	1.003.015,01	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/24	LIGHT	934.008,73	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	2.217.259,63	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.246.655,56	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.917.726,55	-	A+ br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.494.394,06	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/05/22	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	491.775,61	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.348.352,56	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.555.475,98	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	574.011,38	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.149.329,71	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.129.443,13	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.438.939,40	brAAA	A2 br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.005.202,79	brAAA	A2 br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.228.531,98	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.584.209,10	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	836.129,56	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	28/04/21	15/03/28	BRISANET	507.444,50	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	459.209,11	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	524.449,90	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	273.591,18	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	1.907.811,14	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	886.379,98	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	72.315,38	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	770.170,56	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	870.906,31	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.307.357,91	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.327.369,71	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.205.713,23	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.135.631,92	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.601.171,81	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/07/22	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	1.445.868,08	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	10/01/22	10/01/28	AMBIPAR	2.308.931,81	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	03/05/21	26/04/26	GGSH PAR	2.357.671,20	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.411.257,30	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.627.883,83	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.726.184,39	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.210,85	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	512.801,17	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.557.332,38	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.594.785,48	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	-	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	-	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	8.502.225,77	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.760.780,13	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	52.066,49	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.799.179,55	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/10/22	06/10/22	13/09/32	NTRASSUD	1.773.482,85	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	36.325,46	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	2.137.926,11	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/11/22	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	996.298,19	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	5.239.964,22	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.728.277,33	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.582.461,86	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.852.364,84	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	10.577.658,62	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.771.937,50	-	-	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/07/2023

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	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.697.941,65	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.390.260,95	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.425.217,97	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.734.903,18	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.420.778,03	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.696.745,31	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.170.347,30	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.302.396,51	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.679.395,10	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	16/11/20	15/10/36	PAMPASUL	2.458.263,19	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.169.690,86	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/22	20/12/22	16/12/29	CSMG	2.008.361,15	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	1.180.831,72	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDOVE	2.000.048,64	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	3.188.297,22	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	3.074.919,72	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	26/01/23	20/01/26	HAPVIDA	471.869,42	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	AESTUCAN	1.151.963,87	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	ITAPOA T	3.585.203,64	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	BRV_VDR	8.587.436,06	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/03/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	974.143,20	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/04/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	690.128,70	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	26/01/23	20/01/26	VERO	2.904.137,01	-	brA+	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	1.138.871,98	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	31.438,14	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	2.284.440,65	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	PAMPASUL	1.883.112,70	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	LOCAMERI	2.246.249,30	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	MG050	3.237.545,35	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	BRK AMBI	1.303.512,92	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	VAMOS	1.731.436,89	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	793.159,67	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	1.499.800,82	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	2.439.317,98	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	295.255,44	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	2.818.246,43	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CORSAN	1.586.770,91	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	647.641,26	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	METRORIO	5.203.721,88	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HIDRO BR	2.633.388,53	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	225.276,12	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	26/01/23	20/01/26	BRK AMBI	2.280.302,64	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	2.136.079,96	brAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	1.143.638,62	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	SABESP	2.296.745,40	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	CPFL	2.314.448,03	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	CACHOEIR	1.833.165,22	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	COELBA	1.844.250,16	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	LOCAMERI	2.897.614,07	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	SMARTIFI	3.092.582,83	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/05/23	26/01/23	20/01/26	UNIGEL P	127.463,09	BB-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	59.549,09	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/06/23	26/01/23	20/01/26	OURO VER	286.985,42	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/01/23	20/01/26	GBS PART	2.888.440,32	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/01/23	20/01/26	ASA BRAN	2.900.028,27	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/06/23	26/01/23	20/01/26	IGUA RJ	1.259.135,47	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	26/01/23	20/01/26	VAMOS	1.021.713,06	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/06/23	26/01/23	20/01/26	1V11	369.385,26	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	1.495.343,75	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	984.159,90	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	984.159,90	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	PAMPASUL	3.036.745,45	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	1.495.343,75	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	26/01/23	20/01/26	1V11	1.120.103,56	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	26/01/23	20/01/26	1V11	273.803,09	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/07/23	26/01/23	20/01/26	RD COLIN	1.560.693,34	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ECORODOV	1.400.670,73	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ECORODOV	1.400.670,73	brAAA	A2.br	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/07/2023

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	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ITAPOA T	2.320.109,24	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ASA BRAN	2.854.483,27	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN3	1.409.777,78	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN4	3.476,33	-	-	AAAsf(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.509.059,32	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	291.666,67	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	1.322.222,22	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.437.500,00	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	756.821,71	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	2.907.580,14	-	-	Aasf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.634.403,81	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	2.426.706,81	-	AAA.br	-

Observação: Em julho de 2023, nenhum dos ativos da carteira de crédito da EMBRAER PREV sofreu rebaixamento de sua classificação de risco e ficou abaixo da classificação mínima de crédito estabelecida pela Política de Investimento do Plano Embraer Prev.

4. RISCO OPERACIONAL

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

5. RISCO DE LIQUIDEZ

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

6. RISCO LEGAL

Para acompanhamento do risco legal, a Entidade controlará diariamente seus investimentos, através dos relatórios elaborados pelo administrador dos fundos e/ou carteiras da EMBRAER PREV, para que estes estejam enquadrados às

determinações legais e aos limites estabelecidos na Política de Investimento dos Planos sob sua administração. Os seguintes relatórios elaborados pelo administrador são utilizados pela EMBRAER PREV para o controle do risco legal:

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação	4.542.329.942,48
---------------------------------------	-------------------------

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.868.878.194,97	4.542.329.942,48	85,17%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.170.401.894,91	4.542.329.942,48	69,80%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	698.476.300,06	3.633.864.008,13	15,38%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	908.466.002,03	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	454.233.001,02	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.135.582.485,62	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.135.582.485,62	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	568.056.147,15	3.179.630.905,59	12,51%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.135.582.485,62	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	75.594.454,88	908.466.002,03	1,66%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	25.059.795,09	681.349.518,45	0,55%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	908.466.002,03	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	454.233.001,02	0,00%	Enquadrado

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

6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE JULHO DE 2023 À 31 DE JULHO DE 2023



FIM EMB I A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	FONTE ANBIMA			FORA DO TÚNEL
									TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
03/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2026	Venda	0,0654%	0,0667%	0,0362%	0,0817%	-0,0013%	NÃO
03/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2026	Venda	0,0654%	0,0667%	0,0362%	0,0817%	-0,0013%	NÃO
04/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,3490%	5,3900%	5,0614%	5,5711%	-0,0410%	NÃO
07/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,4890%	5,3826%	5,1886%	5,6986%	0,1064%	NÃO
12/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,5700%	5,5643%	5,4064%	5,7105%	0,0057%	NÃO
18/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,5950%	5,5622%	5,4362%	5,7405%	0,0328%	NÃO
21/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,5600%	5,5087%	5,3838%	5,6882%	0,0513%	NÃO
25/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,4900%	5,4970%	5,3344%	5,6386%	-0,0070%	NÃO
27/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,2581%	4,9672%	5,4789%	-0,0071%	NÃO
27/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,4900%	5,5000%	5,3265%	5,6305%	-0,0100%	NÃO
28/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2710%	5,2722%	4,9790%	5,4908%	-0,0012%	NÃO
28/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2610%	5,2722%	4,9790%	5,4908%	-0,0112%	NÃO
31/07/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,4700%	5,4421%	5,3044%	5,6087%	0,0279%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE JULHO DE 2023 À 31 DE JULHO DE 2023



FIM EMB II A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	FONTE ANBIMA			FORA DO TÚNEL
									TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
18/07/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Venda	7,0810%	7,0275%	6,7570%	7,4930%	0,0535%	NÃO
18/07/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Venda	7,0810%	7,0275%	6,7570%	7,4930%	0,0535%	NÃO
18/07/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,3190%	5,2589%	5,0536%	5,5202%	0,0601%	NÃO
25/07/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,1975%	5,1800%	4,9308%	5,3976%	0,0175%	NÃO
28/07/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Compra	6,8195%	6,8902%	6,5031%	7,2402%	-0,0707%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE JULHO DE 2023 À 31 DE JULHO DE 2023



FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	FONTE ANBIMA			FORA DO TÚNEL
									TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
04/07/2023	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2024	Compra	-0,0001%	0,0000%	-0,0435%	0,0187%	-0,0002%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JULHO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
 Mês de Referência: 01 DE JULHO DE 2023 À 31 DE JULHO 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
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	24,48	600,00	14.688,00	24,19	24,48	24,72	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,45	1.800,00	22.410,00	12,18	12,46	12,55	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,47	11.500,00	143.429,28	12,18	12,46	12,55	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,46	600,00	7.475,98	12,18	12,46	12,55	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,22	1.400,00	19.913,03	14,12	14,24	14,31	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,21	3.800,00	54.013,03	14,12	14,24	14,31	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	48,55	700,00	33.986,07	47,95	48,55	48,85	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,00	4.100,00	127.079,97	30,80	31,01	31,14	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,07	600,00	18.639,00	30,80	31,01	31,14	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,16	1.900,00	64.909,15	33,38	34,18	34,48	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,22	200,00	6.844,16	33,38	34,18	34,48	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,17	1.700,00	58.088,38	33,38	34,18	34,48	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,21	800,00	27.368,00	33,38	34,18	34,48	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,95	2.600,00	12.862,39	4,75	4,92	5,00	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	38,74	1.500,00	58.103,72	37,74	38,76	39,04	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,55	1.000,00	12.550,00	12,19	12,53	12,64	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,55	1.000,00	12.550,00	12,19	12,53	12,64	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,54	9.500,00	119.126,87	12,19	12,53	12,64	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,52	4.300,00	53.819,24	12,19	12,53	12,64	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,52	2.500,00	31.300,00	12,19	12,53	12,64	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,82	21.400,00	38.979,16	1,68	1,78	1,87	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	34,02	2.300,00	78.249,09	33,80	34,06	34,29	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	34,14	800,00	27.311,44	33,80	34,06	34,29	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	34,09	2.800,00	95.442,11	33,80	34,06	34,29	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,66	2.800,00	60.660,84	21,47	21,73	22,07	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	28,91	7.600,00	219.694,15	28,43	28,86	29,00	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	18,18	2.100,00	38.185,65	17,90	18,28	18,52	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,33	800,00	13.863,17	16,80	17,34	17,57	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	45,24	2.100,00	94.994,01	44,48	45,14	45,50	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,87	9.700,00	212.139,73	20,76	21,98	22,34	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,00	1.000,00	22.000,00	20,76	21,98	22,34	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,26	1.300,00	28.933,27	20,76	21,98	22,34	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,18	1.900,00	42.142,00	20,76	21,98	22,34	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	70,42	1.600,00	112.667,91	69,05	70,38	70,98	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	70,35	200,00	14.069,83	69,05	70,38	70,98	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,79	800,00	17.428,80	21,64	21,89	22,14	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	44,01	1.400,00	61.617,41	43,29	43,92	44,11	
21-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	17,20	900,00	15.476,91	16,79	17,28	17,53	
21-07-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	49,99	10,00	499,94	49,25	50,05	50,73	
21-07-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	50,04	56,00	2.802,06	49,25	50,05	50,73	
24-07-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	17,67	46.200,00	816.326,98	17,47	17,80	18,09	21.793,00
24-07-23	FIA RVA EMB II	Venda	MEDIA3	40,92	22.500,00	920.708,93	40,33	41,46	44,76	14.351,00
24-07-23	FIA RVA EMB II	Compra	RAIL3	23,84	18.300,00	436.338,83	23,70	23,94	24,20	33.705,00
24-07-23	FIA RVA EMB II	Compra	RAIL3	23,89	4.600,00	109.883,15	23,70	23,94	24,20	33.705,00
24-07-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	69,94	11.000,00	769.302,66	67,51	69,47	70,32	66.515,00
24-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,73	11.800,00	150.267,64	12,42	12,71	12,94	23.308,00
24-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,28	1.200,00	37.536,00	31,00	31,35	31,53	14.799,00
24-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,32	1.500,00	46.987,42	31,00	31,35	31,53	14.799,00
24-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,12	17.900,00	234.817,98	12,53	13,24	13,24	21.617,00
24-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,90	3.900,00	50.298,66	12,53	13,00	13,24	21.617,00
24-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,85	13.800,00	177.327,35	12,53	13,00	13,24	21.617,00
24-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,79	300,00	537,00	1,65	1,72	1,82	2.704,00
24-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	34,40	3.600,00	123.830,91	34,00	34,42	34,62	16.631,00
24-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	45,91	1.400,00	64.277,69	45,26	45,82	46,17	17.742,00
24-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,00	1.600,00	36.800,00	22,35	22,97	23,34	16.103,00
24-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,99	2.500,00	57.472,64	22,35	22,97	23,34	16.103,00
24-07-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	8,13	1.307,00	10.627,82	8,02	8,12	8,22	7.769,00
24-07-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	19,40	6.655,00	129.119,52	18,83	19,31	19,46	20.755,00
24-07-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	19,39	367,00	7.117,95	18,83	19,31	19,46	20.755,00
25-07-23	FIA RVA EMB II	Compra	B3SA3	15,17	36.300,00	550.658,82	14,88	15,15	15,52	45.517,00
25-07-23	FIA RVA EMB II	Compra	BRKM5	25,65	11.200,00	287.280,00	25,30	25,74	26,10	13.039,00
25-07-23	FIA RVA EMB II	Compra	ECOR3	8,06	57.400,00	462.644,00	8,04	8,16	8,38	7.348,00
25-07-23	FIA RVA EMB II	Venda	MEDIA3	40,24	14.800,00	595.570,68	39,88	40,25	40,92	10.606,00
25-07-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	30,45	13.700,00	417.139,45	30,20	30,72	31,05	68.435,00
25-07-23	FIA RVA EMB II	Venda	RENT3	68,16	4.200,00	286.272,00	68,07	68,65	70,37	28.334,00
25-07-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	45,23	14.300,00	646.789,00	44,81	45,19	45,84	15.873,00
25-07-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	72,35	5.700,00	412.404,34	71,62	72,26	72,66	77.143,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	25,22	1.200,00	30.263,57	24,76	25,01	25,54	12.971,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,83	10.800,00	138.562,63	12,58	12,80	13,11	22.047,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,67	1.700,00	21.539,00	12,58	12,80	13,11	22.047,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,69	2.400,00	30.456,35	12,58	12,80	13,11	22.047,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,17	1.400,00	19.834,22	14,05	14,14	14,41	6.048,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	47,62	700,00	33.331,78	47,30	47,54	48,26	30.363,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,31	400,00	12.524,00	31,13	31,31	31,76	17.597,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	33,67	1.100,00	37.039,48	33,35	33,70	34,37	32.452,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,87	3.700,00	18.035,91	4,79	4,86	5,00	23.568,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	39,09	1.500,00	58.634,38	38,62	38,98	39,52	27.696,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,18	3.200,00	42.177,38	12,98	13,16	13,44	13.408,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	34,45	2.600,00	89.574,49	34,19	34,41	34,87	16.045,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	22,22	2.400,00	53.316,80	22,02	22,72	22,72	14.717,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	28,53	2.700,00	77.038,90	28,32	28,56	28,95	38.599,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	19,06	2.000,00	38.115,47	18,52	19,00	19,48	29.765,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	17,93	1.200,00	21.515,36	17,66	17,95	18,27	23.709,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	45,43	600,00	27.260,46	44,82	45,36	46,48	21.058,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	68,82	900,00	61.935,60	68,07	68,65	70,37	28.334,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,47	1.100,00	24.715,11	22,15	22,48	22,78	7.664,00
25-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	11,56	8.800,00	101.730,06	11,22	11,43	11,71	16.465,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JULHO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
 Mês de Referência: 01 DE JULHO DE 2023 À 31 DE JULHO 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
31-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	48,20	1.100,00	53.020,48	47,34	48,18	48,61	19.968,00
31-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	48,21	2.600,00	125.338,26	47,34	48,18	48,61	19.968,00
31-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRR3	17,09	1.000,00	17.086,24	17,01	17,11	17,25	11.921,00
31-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	29,35	9.000,00	264.179,47	29,05	29,35	29,56	8.179,00
31-07-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	29,35	1.500,00	44.025,00	29,05	29,35	29,56	8.179,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ABEV3	14,86	641,00	9.525,26	14,77	14,89	15,10	17.900,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALPA4	9,61	70,00	672,70	9,50	9,64	9,76	8.978,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALSO3	24,25	78,00	1.891,50	24,13	24,39	24,91	12.429,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ARZZ3	82,73	9,00	744,57	82,34	83,03	84,24	6.238,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ASAI3	13,21	174,00	2.298,54	13,13	13,34	13,60	30.071,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AZUL4	17,65	48,00	847,15	17,47	17,74	18,20	11.859,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	B3SA3	14,96	839,00	12.551,44	14,81	14,96	15,15	27.826,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBA53	48,02	207,00	9.940,32	47,48	48,03	48,32	22.176,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBDC3	14,83	219,00	3.247,81	14,77	14,84	14,91	3.491,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBDC4	16,61	753,00	12.507,27	16,53	16,61	16,73	24.060,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BSE3	31,33	99,00	3.101,82	31,11	31,21	31,40	8.958,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BPAC11	33,76	180,00	6.076,80	33,65	33,93	34,16	21.029,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRAP4	23,39	36,00	842,04	23,11	23,42	23,57	6.718,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	9,63	29.499,00	284.041,06	9,19	9,58	9,80	21.110,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRKM5	25,28	38,00	960,64	24,52	25,25	25,40	9.962,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CCRO3	13,29	146,00	1.940,34	13,25	13,36	13,51	10.999,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CIEL3	4,67	160,00	747,20	4,62	4,69	4,76	24.574,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIG4	12,66	211,00	2.671,26	12,60	12,66	12,77	7.051,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIN3	4,42	163,00	720,63	4,29	4,41	4,45	9.177,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	COGN3	3,32	266,00	883,12	3,30	3,34	3,44	14.572,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPFE3	35,59	28,00	996,52	35,49	35,75	36,14	6.621,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPL6	8,34	228,00	1.901,33	8,24	8,34	8,43	15.515,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CRFB3	13,27	78,00	1.035,06	12,68	13,36	13,72	19.912,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CSAN3	19,95	172,00	3.431,40	19,82	19,93	20,09	13.189,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CSNA3	13,83	86,00	1.189,38	13,48	13,80	13,89	10.333,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CYRE3	23,96	40,00	958,40	23,62	23,94	24,22	14.708,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EGIE3	44,13	38,00	1.676,94	43,96	44,14	44,56	4.316,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET3	39,14	295,00	11.546,27	38,12	38,86	39,37	21.585,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET6	44,09	41,00	1.807,49	42,92	43,76	44,30	5.409,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EMBR3	18,53	107,00	1.982,35	18,35	18,52	18,70	8.095,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENEV3	13,36	231,00	3.086,06	13,05	13,36	13,49	16.220,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENGI11	49,97	36,00	1.798,83	49,83	50,16	50,89	6.622,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EQLT3	33,46	930,00	31.116,37	33,32	33,58	34,14	31.257,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	FLRY3	16,10	61,00	982,10	16,04	16,18	16,40	9.245,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GGBR4	29,11	160,00	4.657,54	28,45	29,15	29,30	20.953,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GOAU4	13,70	97,00	1.328,90	13,43	13,70	13,78	7.797,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HAPV3	4,78	633,00	3.025,74	4,66	4,79	4,84	36.144,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HYPE3	43,38	59,00	2.559,42	43,10	43,34	44,27	21.225,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	IGTI11	21,81	32,00	697,87	21,66	21,92	22,32	22.534,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	IRBR3	40,47	12,00	485,64	40,23	40,78	41,54	7.441,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITSA4	9,83	733,00	7.205,39	9,78	9,82	9,91	20.343,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITUB4	28,66	723,00	20.721,18	28,49	28,66	28,88	24.013,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	JBSS3	18,67	166,00	3.099,22	18,46	18,70	18,82	9.595,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	KLBN11	22,96	103,00	2.364,88	22,75	22,98	23,24	16.890,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LREN3	18,70	139,00	2.599,30	18,69	18,90	19,25	24.990,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MGLU3	3,28	420,00	1.377,60	3,20	3,29	3,37	38.418,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRVE3	13,95	3.820,00	53.274,52	13,84	13,94	14,15	21.144,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MULT3	26,36	39,00	1.028,04	26,32	26,51	27,08	16.501,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	NTCO3	18,20	122,00	2.220,39	18,01	18,21	18,33	16.472,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETR3	34,60	437,00	15.120,20	33,50	34,50	34,83	24.340,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETRA	30,92	688,00	21.272,96	30,30	30,84	31,15	131.506,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PRI03	45,48	123,00	5.593,92	45,20	45,81	46,56	21.353,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RADL3	29,09	169,00	4.916,19	28,83	28,99	29,25	14.569,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAIL3	23,07	177,00	4.083,39	23,02	23,20	23,65	29.422,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAIZ4	4,13	175,00	722,75	4,10	4,14	4,19	15.443,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RDOR3	36,14	161,00	5.818,54	35,83	36,14	36,68	10.754,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RENT3	67,08	127,00	8.518,86	66,44	66,99	67,66	23.930,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RRRP3	35,54	34,00	1.208,24	35,38	35,59	35,85	7.399,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SANB11	28,69	52,00	1.491,94	28,52	28,65	29,00	3.657,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SBS3	57,29	50,00	2.864,42	56,66	57,74	58,13	9.000,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SLCE3	43,51	15,00	652,65	43,33	43,65	44,28	7.499,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SMT03	33,53	21,00	704,13	32,79	33,42	33,78	8.127,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SOMA3	11,28	71,00	800,88	11,11	11,28	11,39	17.214,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SUZB3	48,42	106,00	5.132,18	47,34	48,18	48,61	19.968,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TAE11	36,20	32,00	1.158,51	36,00	36,15	36,36	10.156,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TIMS3	14,34	118,00	1.692,12	14,26	14,44	14,63	13.694,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TOTS3	29,66	75,00	2.224,39	29,15	29,58	29,84	13.031,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	UGPA3	18,91	159,00	3.006,69	18,81	18,91	19,05	7.555,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	USIM5	7,21	75,00	540,75	7,13	7,20	7,28	10.009,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VALE3	69,36	608,00	42.171,00	67,84	69,14	69,68	68.935,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VBRR3	17,09	163,00	2.785,50	17,01	17,11	17,25	11.921,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIVT3	42,34	62,00	2.625,34	42,05	42,30	42,77	9.720,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	WEGE3	39,93	184,00	7.347,19	39,81	39,97	40,29	18.492,00
31-07-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	YDUQ3	21,95	43,00	943,85	21,63	22,06	22,27	14.646,00

7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

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

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

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

8. GLOSSÁRIO

Administrador

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

Carteira

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

Dados Gerais

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

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

Duration

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

Vide também glossário de Valor Presente.

ETL (Expected Tail Loss)

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

Fundo de Investimento

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

Índice de Referência (*Benchmark*)

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

LDI (*Liability Driven Investments*)

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

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

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

Patrimônio de Cobertura

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

Patrimônio Líquido (PL)

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

Rating

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

Stress Testing

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

Tracking Error

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

Túnel de Preços

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

Valor Presente

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

Value at Risk (VaR)

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