



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Outubro/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

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL								Data:	
CNPJ:		10679245000140								31/10/2023	
Dados Gerais											
PL:	554.173.494,71	0,00	VAR / PL:	4,3133%	Limite Fundo:	0,00	0,00%	Dutacion DC:	2,17		
VAR:	23.903.187,26	0,00	ETL / PL:	5,4091%	Status:	ENQUADRADO	0,00%	Dutacion DU:	1,80		
ETL:	29.975.561,17	0,00	VAR / CDI:	0,0481%	Benchmark:						
Cenários de STRESS											
Cenário Alta - 09999 (+):	145.782.529,95	Cenário Baixa - 10000 (+):	-	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	81.523.367,05	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-				
Cenário Alta - 09999 (-):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	(144.028.024,71)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(82.191.951,22)				
Cenário Alta - 09999:	145.782.529,95	Cenário Baixa - 10000:	(144.028.024,71)	CENÁRIO BRADESCO 1:	81.523.367,05	CENÁRIO BRADESCO 2:	(82.191.951,22)				
Parâmetros do Cálculo											
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA								
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94								
Horizonte:	21										
Produtos											
	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2			
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00			
FIA RVA EMB II	200.698.057,60	7.187.037,16	7.118.374,98	29,78%	51.689.391,26	-52.206.686,36	28.814.820,01	-29.050.723,90			
FIA RVA EMB III	99.343.138,60	4.200.401,76	4.013.759,85	16,79%	26.731.308,54	-26.049.976,15	12.887.609,48	-12.995.350,88			
FIA RVA EMB IV	95.637.831,78	4.412.619,82	4.198.014,31	17,56%	25.847.228,66	-23.835.259,33	12.768.801,96	-12.873.850,30			
FIC FIA EMB VIII ETF	164.709.502,47	5.311.262,32	5.231.978,81	21,89%	14.823.264,77	-14.823.264,64	12.072.757,68	-12.171.593,58			
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	103.690.418,82	3.407.016,49	3.341.069,30	13,98%	26.691.336,73	-27.112.838,22	14.979.377,93	-15.100.432,59			
Total Var:	663.978.949,27	24.518.337,54	23.903.187,26	100,00%	145.782.529,95	-144.028.024,71	81.523.367,05	-82.191.951,22			



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		FI RF EMB II								Data:	
CNPJ:		11005764000196								31/10/2023	
Dados Gerais											
PL:	2.703.426.441,27	0,00	VAR / PL:	2,1743%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2,408,32			
VAR:	58.779.639,83	0,00	ETL / PL:	2,7266%	Status:	ENQUADRADO	0,00%	Dutacion DU:	1,656,36		
ETL:	73.712.039,72	0,00	VAR / CDI:	0,0243%	Benchmark:						
Cenários de STRESS											
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	216.382.242,07	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	173.598.009,08	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-				
Cenário Alta - 09999 (-):	(150.695.262,20)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(309.691,40)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(195.479.330,87)				
Cenário Alta - 09999:	(150.695.262,20)	Cenário Baixa - 10000:	216.072.550,67	CENÁRIO BRADESCO 1:	173.598.009,08	CENÁRIO BRADESCO 2:	(195.479.330,87)				
Parâmetros do Cálculo											
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA								
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94								
Horizonte:	21										
Produtos											
	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2			
CSMGC3	10.891.962,03	140.982,84	90.756,47	0,15%	0,00	0,00	0,00	0,00			
ELET42	14.423.114,33	743.785,63	537.604,13	0,91%	0,00	0,00	0,00	0,00			
ENTV12	14.039.193,77	709.119,12	505.808,39	0,86%	-20.947,39	21.361,95	90.220,07	-137.315,43			
GASPI7	50.377.203,02	1.135.576,38	805.177,21	1,37%	0,00	0,00	0,00	0,00			
IGSN15	2.644.254,45	117.515,71	84.270,65	0,14%	-373.108,91	-110.642,74	56.800,04	-76.403,65			
NEOE16	7.209.077,47	397.672,16	284.888,49	0,48%	0,00	0,00	0,00	0,00			
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	123.127.596,81	630.507,27	233.420,58	0,40%	-1.172.623,70	-28.540,21	413.056,95	-539.704,97			
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	41.900.393,92	762.443,59	572.781,15	0,97%	-1.148.125,00	37.705,68	442.072,99	-573.205,72			
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.080.809,16	537.432,38	516.430,82	0,88%	-1.477.341,74	1.732.328,25	1.212.393,67	-1.592.854,43			
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	238.279.179,14	5.936.969,92	5.883.020,80	10,01%	-237.518,92	27.466,75	104.336,74	-132.780,85			
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	29.077.215,04	867.470,30	866.290,78	1,47%	-609.540,33	-9.032,36	218.499,72	-285.209,24			
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	225.970.647,68	7.420.325,04	7.401.702,37	12,59%	-1.366.844,71	1.417.837,24	936.226,21	-1.259.067,15			
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	702.062.576,23	25.679.326,47	25.593.243,38	43,54%	-1.129.062,72	1.275.357,45	983.707,57	-1.297.221,28			
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	224.156.140,10	6.844.866,92	6.804.818,45	14,64%	-1.403.842,36	1.546.816,81	1.288.884,33	-1.641.715,39			
PETRA5	9.211.828,20	212.844,78	112.233,28	0,19%	-17.793.175,65	20.776.261,49	17.719.464,41	-21.703.593,52			
SSPC2	9.874.156,92	100.567,58	66.518,68	0,11%	-2.643.760,19	3.473.309,82	2.875.701,44	-3.383.403,92			
BBTOPIND	321.948.371,76	6.702.038,26	6.623.829,29	11,27%	-20.952.398,12	33.803.439,48	25.622.260,75	-29.219.293,54			
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-74.859.772,67	113.862.160,67	90.834.281,55	-100.357.861,70			
COMPROMISSADA_PRE	745.959.591,76	10.772,65	-3.155,07	-0,01%	-24.933.855,20	38.408.196,47	30.713.786,51	-33.163.358,20			
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-79.705,46	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00			
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-276.434,99	-68.188,42	44.802,25	-60.452,56			
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-296.909,59	-93.287,68	41.513,90	-55.889,34			
Total Var:	2.797.158.806,33	60.750.815,99	58.779.639,83	99,97%	-150.695.262,20	216.072.550,66	173.598.009,08	-195.479.330,87			

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/10/2023

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO
CNPJ: 20726178000121

		Dados Gerais							
PL:	140.434.918,60	VAR / PL:	2,2227%	Limite Fundo:		0,00%	Dutacion DC:		754,69
VAR:	3.121.492,08	ETL / PL:	2,7874%	Status:	ENQUADRADO		Dutacion DU:		518,52
ETL:	3.914.477,00	VAR / CDI:	0,0248%	Benchmark:					

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	408.140,25	CENARIO BRADESCO 1 (+):	2.035.544,40	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(7.170.570,33)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.055.813,09)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(2.679.746,22)
Cenário Alta - 09999:	(7.170.570,33)	Cenário Baixa - 10000:	(647.672,84)	CENARIO BRADESCO 1:	2.035.544,40	CENARIO BRADESCO 2:	(2.679.746,22)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	7.856.897,51	151.714,37	146.783,22	4,70%	-418.409,92	-78.934,00	99.873,52	-132.687,30
AEGP23	14.758.777,14	263.483,60	210.714,58	6,75%	-621.882,92	-181.526,61	98.735,52	-132.747,67
CCRDD1	6.406.419,34	68.681,01	53.705,84	1,72%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	1.420.602,76	14.483,93	13.636,70	0,44%	-125.377,57	-31.829,00	20.683,48	-27.840,81
ENJG21	1.896.780,06	32.596,10	31.043,85	0,99%	-42.795,84	-13.433,53	5.989,59	-8.063,61
ENMI21	1.189.310,40	21.004,95	19.997,00	0,64%	-157,15	160,26	676,83	-1.030,14
ENTV12	18.455.690,14	932.194,86	889.434,63	28,49%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	12.921.100,71	213.147,11	169.946,36	5,44%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	4.393.499,99	46.792,72	36.089,11	1,16%	-93.189,06	-19.468,00	21.022,14	-27.968,75
GASP17	10.422.869,59	234.946,84	128.739,40	4,12%	-60.577,11	-12.457,10	13.840,95	-18.408,89
GRRB24_VENCIMENTO	15.705.809,74	881.626,00	837.961,72	26,84%	-1.509.305,99	49.567,26	581.141,79	-753.526,68
LFSN16000GM	14.675.157,78	237.996,60	206.061,02	6,60%	-522.273,56	-160.371,56	78.234,47	-105.246,10
LFSN18000DC5	4.819.343,89	66.136,88	53.075,24	1,70%	-84.803,70	-21.486,79	14.029,15	-18.882,68
OMGE31	12.947.581,85	217.036,92	173.570,11	5,75%	-305.656,91	358.412,74	250.840,07	-329.556,09
SBSPO2	7.567.164,71	77.071,03	72.543,55	2,32%	-1.326.310,32	-24.462,64	472.368,71	-616.934,45
TAE33	4.133.537,24	87.944,27	72.240,99	2,31%	-646.451,13	-156.705,39	109.661,04	-147.516,60
CAIXA	1.003,03	0,00	0,00	0,00%	-278.031,93	-77.633,72	48.875,06	-65.542,49
COMPROMISSADA_PRE	5.596.159,24	80,82	-51,15	0,00%	-779.830,59	-188.222,99	160.845,39	-214.719,70
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-21.271,78	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-227.539,81	-71.492,00	31.814,62	-42.831,38
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-128.976,84	-17.789,86	26.912,07	-36.242,89
Total Var:	145.146.529,35	3.551.937,99	3.121.492,08	99,97%	-7.170.570,33	-647.672,84	2.035.544,40	-2.679.746,22

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/10/2023

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

Dados Gerais						
PL:	246.422.635,55	VAR / PL:	2,0697%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:
VAR:	5.100.105,63	ETL / PL:	2,6954%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:
ETL:	6.395.738,21	VAR / CDI:	0,0231%	Benchmark:		778,52
						535,23

Cenários de STRESS						
Cenário Alta - 09999 (+):	445.356,48	Cenário Baixa - 10000 (+):	7.663.009,15	CENARIO BRADESCO 1 (+):	10.141.028,97	CENARIO BRADESCO 2 (+):
Cenário Alta - 09999 (-):	(11.862.392,66)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(449.766,39)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.354.140,75)	CENARIO BRADESCO 2 (-):
Cenário Alta - 09999:	(11.417.036,18)	Cenário Baixa - 10000:	7.213.242,76	CENARIO BRADESCO 1:	8.786.888,22	CENARIO BRADESCO 2:
						(9.932.084,87)

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
RODB11	2.803.837,26	5.234,93	4.864,79	0,10%	-22.478,37	19.013,55	29.681,82	-39.744,91
RSAN24	793.334,49	65,40	61,10	0,00%	-253,65	206,78	359,68	-526,30
RSAN44	866.970,39	35.613,58	27.051,65	0,33%	-67.226,84	-1.077,86	23.626,87	-30.723,25
SMFT16	2.654.220,37	1.786,47	1.702,13	0,03%	-7.095,66	5.870,92	9.234,88	-12.630,54
SNGO18	1.763.655,24	123,77	114,84	0,00%	-501,25	409,97	733,84	-1.079,56
TBSP11	2.639.038,15	1.007,93	963,66	0,02%	-3.934,03	3.230,85	5.160,78	-7.276,93
UGEL11	1.142.508,16	260,83	248,35	0,00%	-985,53	800,69	1.305,47	-1.873,52
UNEG11	4.544.193,79	210.339,10	169.901,02	3,33%	-538.293,17	154.982,73	300.309,86	-368.707,75
VAMO33	2.775.143,47	161.279,52	111.018,54	2,18%	-257.630,56	31.094,17	112.967,07	-145.114,84
VCCS11	853.551,21	788,81	737,95	0,01%	-3.323,22	2.796,80	4.359,70	-5.894,89
VECS11	3.618.447,10	205,57	189,31	0,00%	-837,27	683,39	1.232,66	-1.817,38
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	1.185.621,06	125,98	117,98	0,00%	-482,40	391,52	672,56	-862,43
VVEO15	1.624.638,57	491,58	469,42	0,01%	-1.895,41	1.513,94	2.424,35	-3.448,14
VVEO16	1.048.576,27	361,88	355,00	0,01%	-1.448,29	1.182,62	1.871,16	-2.544,98
Total Var:	260.265.907,95	6.546.427,94	5.100.105,63	99,97%	-11.417.036,18	7.213.242,76	8.786.888,21	-9.932.084,87

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/10/2023

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		1.924,91	
PL:	285.542.584,82	VAR / PL:	5,1434%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	1.323,60
VAR:	14.686.579,51	ETL / PL:	6,4500%	Benchmark:			
ETL:	18.417.563,21	VAR / CDI:	0,0574%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	4.628.712,60	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	13.827.574,81	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(30.470.757,19)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(497.396,08)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(17.445.639,36)
Cenário Alta - 09999:	(30.470.757,19)	Cenário Baixa - 10000:	4.131.316,52	CENÁRIO BRADESCO 1:	13.827.574,81	CENÁRIO BRADESCO 2:	(17.445.639,36)

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	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ANEM11	10.715.250,97	459.137,82	454.696,27	3,10%	-1.114.085,51	248.199,04	572.240,96	-708.806,49
ANET11	2.203.310,70	66.581,99	65.381,77	0,45%	-138.607,62	-16.453,92	39.593,65	-62.143,37
ASAB11	6.555.631,80	276.808,41	276.304,75	1,88%	-525.842,86	96.443,79	215.082,73	-275.615,33
BRKP29	8.953.683,64	450.518,84	444.593,57	3,03%	-996.241,92	221.115,01	504.054,64	-634.054,69
BTOW15	5.179.705,78	342.108,81	338.866,96	2,31%	-571.665,86	122.147,05	283.560,41	-361.413,48
CAEC21	8.817.828,16	401.370,33	395.278,48	2,69%	-698.884,81	-40.406,91	231.708,50	-303.786,61
CAIXA	1.000,02	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	9.877.552,78	468.122,37	467.846,00	3,19%	-935.066,58	141.230,49	431.667,43	-547.165,68
CBAN32	9.879.338,68	522.375,75	521.040,94	3,55%	-966.634,83	145.752,02	446.816,82	-567.956,64
CBAN72	4.638.522,40	247.101,18	246.500,87	1,68%	-465.428,96	77.426,37	219.914,23	-278.964,51
CJEN13	7.022.519,23	314.309,33	314.102,91	2,14%	-653.289,55	98.605,39	301.427,34	-381.348,55
CNRD11	8.320.029,13	388.166,13	386.456,45	2,63%	-840.955,52	169.038,64	415.949,90	-522.983,55
COMPROMISSADA_PRE	18.691.220,10	269,93	-185,05	0,00%	-524,87	535,26	2.260,61	-3.440,66
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-141.391,79	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	6.897.165,02	302.805,76	298.881,13	2,04%	-538.984,40	-26.095,01	181.213,26	-237.105,90
CREDEM24	210.806,29	118.143,91	80.462,57	0,41%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	8.378.795,49	329.700,80	327.661,43	2,23%	-616.119,11	1.340,43	223.825,94	-290.311,75
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	6.779.270,84	111.831,19	76.062,69	0,52%	-274.019,53	-84.141,61	41.047,02	-55.219,12
ERDV38	5.875.076,75	89.566,83	67.832,70	0,46%	-335.601,92	-83.195,24	66.295,10	-88.618,53
GBSP11	4.907.051,26	229.273,61	222.311,73	1,51%	-646.916,09	179.639,39	364.292,94	-438.264,88
GRRB24	8.274.966,53	464.504,91	454.329,72	3,09%	-698.270,18	-12.888,65	248.878,30	-325.046,08
HARG11	10.403.733,92	455.209,70	452.061,07	3,08%	-1.041.330,18	228.681,19	526.610,65	-657.573,81
HBSA21	7.513.583,03	435.659,82	431.962,13	2,94%	-728.948,34	102.706,11	329.016,19	-421.410,53
HVRD15	10.777.658,70	594.689,83	593.946,39	4,04%	-1.152.953,71	220.950,53	564.157,03	-712.470,88
IPIL11	8.123.944,08	332.232,82	332.137,48	2,26%	-680.359,62	69.663,21	291.648,78	-371.028,00
IRBR12	11.556.340,96	235.118,69	177.727,28	1,21%	-745.203,68	-144.452,32	180.215,13	-239.608,08
ITPO14	8.196.516,04	432.887,08	431.237,63	2,94%	-923.594,69	225.778,22	483.262,30	-603.883,55
LAMEA6	8.988.339,60	482.887,96	479.306,15	3,26%	-814.862,24	106.738,46	360.737,54	-462.716,73
LCAMD1	7.504.941,00	432.407,58	428.542,16	2,92%	-716.805,76	95.969,84	320.217,46	-410.515,93
LORTA7	6.225.754,88	365.616,66	362.220,39	2,47%	-602.184,26	86.746,19	272.355,60	-349.130,66
MOVIS7	8.478.411,54	479.330,43	475.219,59	3,24%	-798.754,18	101.266,85	353.216,80	-453.060,94
MTRJ19	9.005.735,56	362.832,43	360.857,20	2,46%	-665.777,46	12.708,73	249.797,05	-323.138,85
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	4.614.653,63	160.473,09	158.747,47	1,08%	-308.705,62	-20.104,71	98.927,24	-129.298,02
QUAT12	4.040.728,74	63.358,53	39.283,83	0,27%	-232.400,55	-57.621,16	46.505,72	-62.209,84
RAHD11	12.755.634,63	559.041,59	554.288,91	3,77%	-1.371.984,80	295.988,52	702.738,20	-867.597,52
RDVE11	7.436.515,26	318.967,98	318.274,37	2,17%	-715.552,12	122.012,79	339.619,81	-425.925,73
RMSA12	10.947.299,64	548.032,76	532.741,87	3,63%	-1.513.561,06	437.183,19	860.916,64	-1.043.624,40
RSAN44	7.269.305,88	298.610,00	296.369,08	2,02%	-563.678,37	-9.037,52	198.121,50	-257.605,93
TCM11	13.632.229,19	617.585,87	610.300,81	4,16%	-1.555.486,78	340.434,86	806.040,63	-988.731,84
UNEG11	5.494.102,52	254.307,94	248.722,44	1,69%	-650.816,85	187.375,99	363.086,00	-445.781,64
UTPS21	6.188.972,50	310.260,22	308.733,65	2,10%	-665.167,41	161.193,26	346.137,45	-432.951,41
VAMO33	8.541.658,75	496.404,84	490.375,27	3,34%	-792.965,23	95.705,25	347.703,16	-446.651,30
VAMO34	6.993.013,98	394.663,05	391.498,34	2,67%	-664.993,52	86.627,07	295.648,43	-378.976,46
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	4.806.887,07	235.744,56	232.493,77	1,58%	-390.748,92	-2.999,04	140.780,12	-183.429,35
VIMT13	7.147.868,82	328.124,79	327.279,99	2,23%	-699.403,49	143.568,91	347.181,89	-435.586,85
VRDN12	4.976.401,12	233.966,76	233.826,35	1,59%	-467.378,24	65.933,57	213.104,09	-270.485,33
Total Var:	343.867.565,77	15.008.812,86	14.686.579,51	100,03%	-30.470.757,19	4.131.316,53	13.827.574,81	-17.445.639,37

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/10/2023

FUNDO: FIM EMB II A
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais		Limites Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		719,31	
PL:	195.373.210,83	VAR / PL:	0,5218%	Status:		Dutation DU:			494,18
VAR:	1.019.544,59	ETL / PL:	0,6544%	Benchmark:					
ETL:	1.278.550,05	VAR / CDI:	0,0058%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	3.346.940,22	Cenário Baixa - 10000 (+):	5.098.898,69	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.704.991,30	CENARIO BRADESCO 2 (+):	6.023.157,15			
Cenário Alta - 09999 (-):	(5.380.034,42)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(2.867.746,00)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(4.896.454,35)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.458.253,37)			
Cenário Alta - 09999:	(2.033.094,20)	Cenário Baixa - 10000:	2.231.152,69	CENARIO BRADESCO 1:	1.808.536,95	CENARIO BRADESCO 2:	(2.435.096,22)			

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CDB323RSITI	6.238.554,22	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	698.290,20	10,08	-0,68	0,00%	-19,61	20,00	84,46	-128,54
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-28.293,34	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT16	148.639,96	34,34	-33,35	0,00%	167,72	-129,49	-241,12	363,80
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF24	6,45	36,50	9,16	0,00%	-706,88	718,55	2.330,71	-3.526,79
DHF25	-1.129,06	18.954,15	-18.581,99	-1,82%	69.120,04	-54.566,68	-90.529,76	132.450,99
DHF26	-2.288,26	69.875,93	66.642,79	6,54%	-245.889,67	199.579,29	306.095,29	-432.986,73
DHF27	-133,36	2.588,66	2.281,67	0,22%	-10.156,10	8.472,32	12.863,81	-17.570,30
DHF29	-45,79	4.238,82	2.859,05	0,28%	-19.554,68	17.089,90	26.515,55	-33.676,91
DHF33	238,98	3.056,48	1.238,27	0,12%	-14.164,54	13.268,94	21.510,99	-23.633,25
DHJ24	20,03	169,22	164,22	0,02%	-1.097,34	1.000,92	2.200,72	-3.302,09
DHJ25	-3.797,46	100.806,62	-98.465,00	-9,66%	349.950,85	-277.048,92	-449.980,30	653.046,23
DHN24	62,13	453,38	440,64	0,04%	-2.148,55	1.796,54	3.395,64	-5.052,77
DHN25	-7.427,45	637.597,71	-619.821,51	-60,79%	2.181.075,61	-1.740.271,76	-2.759.022,30	3.972.091,35
DHN26	8.756,31	186.847,28	-171.962,68	-16,87%	694.893,44	-573.097,83	-872.573,98	1.213.482,22
DHN27	-80,83	1.325,08	1.108,79	0,11%	-5.527,53	4.664,87	7.135,42	-9.578,20
DHV24	44,85	418,52	409,29	0,04%	-1.649,10	1.316,16	2.284,32	-3.370,12
DHV25	-8,86	1.010,62	976,41	0,10%	-3.460,04	2.775,68	4.316,53	-6.159,13
ERDV18	1.334.261,17	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24P381200	-51.742,56	10.653,81	-2.674,65	-0,26%	51.742,56	-222.631,31	-724.106,90	51.742,56
IDIF24P381300	91.314,48	11.091,08	2.784,43	0,27%	-91.282,29	223.169,55	724.776,69	-91.314,48
LF002306J15	10.361.592,28	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306SWQ	10.372.134,24	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	6.226.135,44	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250901 - 210100	112.048,42	19,39	-4,61	0,00%	-604,18	826,88	2,10	-3,19
LFT20260301 - 210100	3.219.332,66	732,85	-41,18	0,00%	-20.105,94	32.513,59	587,18	-893,75
LFT20260901 - 210100	1.649.444,66	605,03	53,18	0,01%	-10.578,22	22.267,16	866,96	-1.319,05
LTM20250401 - 100000	11.896.851,44	101.005,97	96.523,28	9,65%	-357.727,53	293.205,57	489.979,86	-667.556,37
LTM20250701 - 100000	61.033.320,30	628.470,71	610.932,16	59,82%	-2.166.815,63	1.755.364,20	2.771.148,51	-3.989.122,10
LTM20260701 - 100000	11.979.623,85	186.283,81	172.377,65	16,91%	-688.453,76	612.259,86	899.969,45	-1.250.743,89
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	12.881.066,65	65.960,89	57.232,68	5,61%	-142.993,27	148.327,89	97.943,86	-131.718,06
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	18.943.236,78	216.359,04	209.295,31	20,53%	-350.773,56	357.203,93	250.726,96	-334.800,41
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	12.121.988,57	384.347,81	383.734,42	37,64%	-569.160,52	642.907,69	495.886,99	-653.929,25
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	5.238.543,75	97.647,82	96.963,26	9,51%	-163.235,96	194.454,06	150.763,23	-197.345,12
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	12.467.043,21	234.732,59	223.103,57	21,88%	-513.929,55	565.695,46	463.603,09	-600.520,89
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
Total Var:	195.938.424,04	2.965.335,20	1.019.544,59	100,01%	-2.033.094,20	2.231.152,69	1.808.536,95	-2.435.096,22

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/10/2023

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais					
PL:	66.761.770,93	VAR / PL:	2,7471%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	1.834.037,36	ETL / PL:	3,4450%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	2.299.956,85	VAR / CDI:	0,0306%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	1,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	34.510.578,65	Cenário Baixa - 10000 (-):	6,85	CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.317.380,97
Cenário Alta - 09999 (-):	(6,72)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(34.474.988,67)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	34.510.571,93	Cenário Baixa - 10000:	(34.474.981,82)	CENARIO BRADESCO 1:	8.317.380,97
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.385.478,09)
				CENARIO BRADESCO 2:	(8.385.478,09)

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

Produto	MiTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	2.090.759,50	179.726,59	169.697,10	9,25%	1.045.379,75	-1.045.379,75	306.505,34	-309.014,25
EMLC11	3.248.430,38	169.499,10	89.394,66	4,87%	3.248.430,38	-3.248.430,38	476.219,89	-480.116,01
BPML11	2.051.685,30	161.298,27	1.842,28	0,10%	2.051.685,30	-2.051.685,30	300.777,07	-303.239,09
BTLG11	2.925.918,36	78.816,38	37.665,13	2,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
CADXA	999,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	646.145,60	51.315,03	-1.215,47	-0,07%	323.072,80	-323.072,80	94.724,95	-95.500,32
CNES11	343.390,74	44.239,07	-19.733,08	-1,08%	171.695,37	-171.695,37	50.341,08	-50.753,15
COMPROMISSADA_PRE	239.288,87	3,46	1,14	0,00%	-6,72	6,85	28,94	-44,05
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-397.446,44	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	1.231.014,75	113.736,91	86.545,55	4,72%	615.507,38	-615.507,38	180.466,76	-181.943,98
GALG11	795.830,67	18.014,54	-13.720,28	-0,75%	424.612,53	-389.016,27	116.668,78	-117.623,77
GALG12	20.129,68	8.214,78	-3.329,09	-0,18%	0,00	0,00	0,00	0,00
HBRH11	3.587.368,22	95.989,92	12.869,68	0,70%	3.587.368,22	-3.587.368,22	525.908,18	-530.213,02
HSLG11	1.182.575,11	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
MALL11	4.448.076,80	83.783,20	41.850,04	2,28%	2.224.038,40	-2.224.038,40	652.088,06	-657.425,75
MAXR11	1.562.406,25	108.043,88	97.432,51	5,31%	781.203,13	-781.203,13	229.048,76	-230.923,64
NEWL11	3.143.426,40	216.684,61	-98.414,06	-5,37%	1.571.713,20	-1.571.713,20	460.826,31	-464.598,42
NEWU11	910.092,00	19.409,61	10.579,43	0,58%	910.092,00	-910.092,00	133.419,49	-134.511,60
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	6.171.120,00	292.756,88	32.959,60	1,80%	3.085.560,00	-3.085.560,00	904.686,19	-912.091,54
QAGR11	5.264.448,80	341.888,76	302.664,96	16,50%	2.632.224,40	-2.632.224,40	771.768,19	-778.085,53
RBRL11	2.435.192,52	117.901,06	78.650,89	4,29%	2.435.192,52	-2.435.192,52	356.999,22	-359.921,45
RCRB11	6.000.300,00	207.281,91	174.277,42	9,50%	0,00	0,00	0,00	0,00
RNGO11	36.573,96	2.343,53	-1.905,84	-0,10%	18.286,98	-18.286,98	5.361,74	-5.405,63
TEPP11	5.667.800,84	184.896,38	153.320,19	8,63%	2.833.894,14	-2.833.900,42	830.899,60	-837.700,96
TRXF11	7.746.281,76	435.280,98	399.066,83	21,76%	3.873.140,88	-3.873.140,88	1.135.604,91	-1.144.900,44
XPIN11	3.473.523,00	190.773,93	86.488,34	4,72%	1.736.761,50	-1.736.761,50	509.218,47	-513.386,70
XPLG13	108,95	4,62	4,06	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
XPLG15	289.153,30	12.865,88	11.496,95	0,63%	0,00	0,00	0,00	0,00
XPBR11	1.881.439,56	191.793,25	180.548,43	9,84%	940.719,78	-940.719,78	275.819,04	-278.076,77
Total Var:	66.996.034,87	3.326.561,55	1.834.037,36	99,98%	34.510.571,93	-34.474.981,82	8.317.380,97	-8.385.478,09

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/10/2023

FUNDO:	FIA RVA EMB III
CNPJ:	38452593000108

Dados Gerais					
PL:	99.343.140,96	VAR / PL:	4,2282%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	4.200.401,76	ETL / PL:	5,3023%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	5.267.473,27	VAR / CDI:	0,0472%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	1,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	27.350.040,54	Cenário Baixa - 10000 (+):	628.690,11	CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.687.279,87	CENARIO BRADESCO 2 (+):	804.239,76
Cenário Alta - 09999 (-):	(618.732,00)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(26.678.666,26)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(799.670,39)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(13.799.590,64)
Cenário Alta - 09999:	26.731.308,54	Cenário Baixa - 10000:	(26.049.976,15)	CENARIO BRADESCO 1:	12.887.609,47	CENARIO BRADESCO 2:	(12.995.350,88)

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
ALOSS3	2.481.306,60	31.743,07	13.668,11	0,33%	0,00	0,00	0,00	0,00
ALPA4	673.200,00	84.890,10	22.897,98	0,54%	169.300,00	-169.300,00	98.691,12	-99.499,96
ASA3	1.724.144,00	145.916,43	88.619,10	2,11%	482.760,32	-448.293,20	252.769,61	-254.828,48
AURE3	2.121.608,06	57.191,67	22.649,93	0,54%	530.402,02	-657.714,31	311.027,74	-313.573,67
BBAS3	2.709.824,10	179.928,77	-56.762,08	-1,35%	677.456,03	-677.456,03	397.260,21	-400.512,00
BBS3	1.900.968,00	100.423,66	51.965,88	1,24%	380.193,60	-380.193,60	278.681,91	-280.963,07
BPAC11	2.754.457,60	214.027,09	186.380,83	4,44%	826.337,28	-964.060,16	403.803,48	-407.108,83
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	2.499.904,00	366.889,43	-139.488,87	-3,32%	749.971,20	-624.976,00	366.485,93	-369.485,81
COMPROMISSADA_PRE	4.393.193,60	63,44	-8,73	0,00%	-123,37	125,81	531,34	-808,69
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-916.752,68	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
DOLZ23	16.967,21	202.789,87	104.453,12	2,49%	-690.490,06	599.993,20	-763.321,74	767.683,41
ELET3	8.429.712,20	466.306,31	202.331,89	4,82%	2.529.913,66	-2.529.913,66	1.235.795,81	-1.245.911,46
ENAT3	721.602,00	95.893,03	50.793,20	1,21%	252.560,70	-252.560,70	105.786,65	-106.652,78
ENEV3	4.348.146,84	396.415,80	327.677,89	7,80%	1.608.814,33	-2.217.554,89	637.438,33	-642.656,10
ENGH1	1.337.707,00	119.385,08	84.295,85	2,01%	227.410,19	-294.295,54	196.107,85	-197.713,10
ENJU3	140.807,00	22.506,27	7.458,83	0,18%	63.363,15	-38.017,89	20.642,31	-20.811,28
EQLT3	8.372.262,00	628.596,79	497.375,63	11,84%	1.674.462,40	-1.674.462,40	1.227.373,61	-1.237.420,32
FLRY3	1.570.952,00	131.330,98	-22.868,53	-0,54%	314.190,40	-314.190,40	230.301,56	-232.186,71
HAPV3	962.835,39	172.898,50	121.108,55	2,88%	327.364,03	-327.390,13	141.151,67	-142.307,07
IGT11	6.930.311,49	429.373,78	215.870,20	5,14%	1.386.062,30	-1.386.062,30	1.015.983,66	-1.024.300,04
ITUB4	8.180.180,46	360.466,35	65.670,23	1,56%	1.636.036,09	-1.554.234,29	1.199.214,46	-1.209.030,67
LREN3	2.796.224,02	305.928,46	120.156,81	2,86%	559.244,80	-559.244,80	409.926,44	-413.281,91
LWSA3	67.796,16	7.783,93	2.815,79	0,07%	35.118,46	-35.118,46	12.870,92	-12.976,27
NTCO3	2.700.654,00	441.967,31	286.280,63	6,82%	675.163,50	-675.163,50	395.915,88	-399.156,66
ONCO3	771.672,00	174.696,86	134.213,87	3,20%	270.085,20	-270.085,20	113.127,12	-114.053,12
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR4	1.389.600,00	92.246,38	-14.574,87	-0,35%	347.400,00	-416.880,00	203.715,36	-205.382,88
PETZ3	162.336,00	38.534,36	27.775,70	0,66%	40.584,00	-40.584,00	23.798,46	-23.993,26
PRI03	2.618.730,00	259.959,17	148.124,98	3,53%	1.571.238,00	-1.571.238,00	383.905,82	-387.048,29
RAIL3	5.593.117,00	453.879,64	403.592,07	9,61%	2.516.902,65	-1.845.753,68	819.950,95	-826.662,69
RDR03	244.306,00	30.421,43	22.704,57	0,54%	73.291,80	-73.291,80	35.815,26	-36.108,43
RECV3	2.705.719,66	383.110,53	160.176,22	3,81%	1.623.431,80	-1.623.431,80	396.658,50	-399.905,37
RENT1	5.439,00	6.474,89	3.524,64	0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	6.702.275,11	555.646,86	456.240,97	10,86%	2.211.760,79	-1.742.591,53	982.553,53	-990.596,26
SBSF3	1.354.184,00	78.065,70	37.921,85	0,90%	338.546,00	-338.546,00	198.523,37	-200.148,40
SCAR3	146.792,00	24.203,32	13.936,95	0,33%	88.075,20	-88.075,20	21.519,71	-21.695,85
SMFT3	2.705.989,00	254.571,91	204.688,55	4,87%	1.082.395,60	-1.082.395,60	396.697,99	-399.945,17
SOMA3	1.628.791,00	213.545,12	165.080,54	3,93%	488.637,30	-488.637,30	238.780,76	-240.735,31
SUZB3	5.492.565,99	647.441,40	178.331,01	4,25%	1.373.141,50	-1.098.513,20	805.210,17	-811.801,25
VBBR3	881.802,82	61.214,14	358,52	0,01%	220.446,25	-220.450,71	129.272,29	-130.330,46
WDOZ23	807,96	9.656,66	4.973,96	0,12%	-28.118,57	28.571,11	-36.348,65	36.556,35
Total Var:	99.343.138,59	8.246.284,52	4.200.401,76	100,02%	26.731.308,54	-26.049.976,15	12.887.609,47	-12.995.350,88

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/10/2023

FUNDO: FIA RVA EMB IV
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais							
PL:	95.637.834,69	VAR / PL:	4,6139%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	1,00
VAR:	4.412.619,81	ETL / PL:	5,7860%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,00
ETL:	5.533.603,27	VAR / CDI:	0,0515%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	25.847.467,59	Cenário Baixa - 10000 (-):	243,69	CENARIO BRADESCO 1 (+):	12.768.801,94	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(238,96)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(23.835.503,00)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(12.873.850,29)
Cenário Alta - 09999:	25.847.228,63	Cenário Baixa - 10000:	(23.835.259,31)	CENARIO BRADESCO 1:	12.768.801,94	CENARIO BRADESCO 2:	(12.873.850,29)

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
AURES	2.423.692,26	65.334,88	28.198,84	0,64%	605.923,07	-751.362,66	355.313,29	-358.221,72
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	8.509.538,62	122,89	-31,71	0,00%	-238,96	243,69	1.029,19	-1.566,43
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	29.305,55	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.067.069,96	140.862,67	109.969,32	2,49%	454.755,39	-454.755,39	303.032,46	-305.512,94
CPLE6	725.676,27	53.923,99	41.711,21	0,95%	159.648,78	-159.648,78	106.384,14	-107.254,95
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET3	1.969.400,68	108.941,32	38.674,24	0,88%	590.820,20	-690.820,20	288.714,14	-291.077,42
ELET6	420.104,70	28.711,70	-2.778,79	-0,06%	126.031,41	-126.031,41	61.587,35	-62.091,48
ENGH1	5.330.412,82	475.718,36	409.994,72	9,29%	906.170,18	-1.172.690,82	781.438,52	-787.835,02
EQTL3	10.038.561,60	753.704,03	679.166,63	15,39%	2.007.712,32	-2.007.712,32	1.471.653,13	-1.483.699,40
GGPS3	6.864.975,48	854.992,42	726.187,81	16,46%	3.089.238,97	-3.089.238,97	1.006.405,41	-1.014.643,38
GMAT3	5.685.214,62	602.348,40	494.221,94	11,20%	1.023.338,63	-909.634,34	833.452,46	-840.274,72
HAFV3	3.817.452,60	665.506,49	435.405,63	9,87%	1.297.933,88	-1.298.037,34	559.638,55	-564.219,49
IGTH1	1.012.762,27	62.745,99	28.644,47	0,65%	202.550,45	-202.550,45	148.469,48	-149.684,79
ITUB4	9.416.421,54	414.942,32	47.493,59	1,08%	1.883.284,31	-1.789.120,09	1.380.447,40	-1.391.747,10
MATD3	1.077.464,96	156.872,13	107.486,86	2,44%	323.239,49	-323.239,49	157.956,36	-159.249,32
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	3.861.267,30	383.304,82	197.305,80	4,47%	2.316.760,38	-2.316.760,38	566.061,79	-570.695,31
RAIL3	11.927.996,88	967.953,10	912.202,10	20,67%	5.367.598,60	-3.936.292,44	1.748.844,34	-1.762.957,94
RENT1	5.404,00	6.433,22	4.078,13	0,09%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	4.737.065,27	392.722,68	329.417,24	7,47%	1.563.231,54	-1.231.636,97	694.453,77	-700.138,25
UGPA3	9.065.853,10	812.193,39	-195.028,52	-4,42%	2.266.463,28	-1.813.170,62	1.329.054,06	-1.339.933,09
VBBR3	6.651.201,31	461.721,76	20.300,19	0,46%	1.662.766,72	-1.662.800,33	975.066,11	-983.047,55
Total Var:	95.637.831,69	7.429.058,57	4.412.619,81	100,02%	25.847.228,63	-23.835.259,31	12.768.801,94	-12.873.850,29



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/10/2023

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

Dados Gerais					
PL:	103.601.297,57	VAR / PL:	3,2886%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	3.407.016,49	ETL / PL:	4,1240%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	4.272.536,13	VAR / CDI:	0,0367%	Benchmark:	Dutacion DC: 8,52 Dutacion DU: 6,15

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	26.697.458,12	Cenário Baixa - 10000 (+):	8.226,44	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.979.377,93
Cenário Alta - 09999 (-):	(6.121,39)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(27.121.064,66)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	26.691.336,73	Cenário Baixa - 10000:	(27.112.838,22)	CENARIO BRADESCO 1:	14.979.377,93
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(15.100.432,59)
				CENARIO BRADESCO 2:	(15.100.432,59)

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

Produto	MMT	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
TABE11	372.027,90	10.305,41	6.664,14	0,20%	93.006,96	-93.006,96	54.539,29	-54.985,72
TIMS3	617.358,32	22.124,55	1.631,77	0,05%	197.554,66	-141.992,41	90.504,73	-91.245,56
TOTS3	655.478,38	33.653,97	21.326,11	0,63%	131.095,68	-131.095,68	96.093,13	-96.879,71
UGPA3	1.119.126,25	100.260,50	-22.999,39	-0,68%	279.781,56	-223.825,25	164.063,91	-165.406,86
USIM5	171.516,28	11.916,00	6.080,83	0,18%	66.891,35	-37.733,58	25.144,29	-25.350,11
VALE3	15.387.345,00	1.391.967,84	1.056.560,22	31,01%	3.846.836,25	-3.846.836,25	2.255.784,78	-2.274.249,59
VAMO3	166.199,58	32.728,85	17.961,34	0,53%	58.169,85	-66.481,96	24.364,86	-24.564,30
VBBR3	1.110.931,44	77.120,09	8.159,32	0,24%	277.727,25	-277.732,86	162.862,55	-164.195,67
VIVT3	964.154,88	54.254,45	-6.444,71	-0,19%	144.621,10	-144.623,23	141.345,11	-142.502,09
WEGE3	2.463.569,31	260.878,45	110.448,31	3,24%	615.884,86	-615.892,33	361.159,26	-364.115,54
YDUQ3	288.414,75	32.607,27	15.330,86	0,45%	100.751,75	-64.603,69	37.883,60	-38.193,70
Total Var:	103.600.418,82	8.250.769,73	3.407.016,49	99,99%	26.691.336,73	-27.112.838,23	14.979.377,93	-15.100.432,59

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 – OUTUBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/10/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	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	622.190,82	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	229.952,32	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	137.971,39	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	459.514,69	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	9.106.159,77	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.261.961,36	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	952.125,33	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.384.701,74	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.721.722,48	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	6.033.390,81	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	13.191.541,42	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	26.170.645,61	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	649.476,71	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	649.476,71	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	649.476,71	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	648.215,53	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	649.476,71	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	12.362.577,40	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	14.247.067,04	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	10.645.734,71	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	1.374.394,38	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUUBB	2.754.212,34	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	563.718,47	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.569.313,61	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.032.638,73	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.145.344,43	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	711.181,88	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.754.108,02	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.534.182,69	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	879.279,43	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	616.567,08	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	172.555,01	-	-	AAA(bra)
FIM EMB II A	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.326.684,90	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	147.828,60	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.408.660,58	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.421.382,90	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.340.801,69	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	613.159,12	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.095.107,61	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.797.507,18	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.445.159,84	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.685.977,00	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.646.219,73	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.793.788,11	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	233.409,89	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	410.801,40	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	466.819,77	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	233.409,89	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	285.693,70	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	204.244,16	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	697.033,33	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	14.191.882,91	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	6.341.923,00	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	4.348.762,67	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	1.416.954,16	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.130.572,49	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.824.119,12	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.142.084,64	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	4.585.469,60	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	28/05/21	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	1.274.695,60	-	Aa1.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	176.028,08	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	212.420,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.669.959,57	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	104.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	832.771,12	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	48.750,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.462.024,78	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.159.229,86	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.591.812,16	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.113.443,45	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	19.316,34	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	449.311,54	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	521.541,06	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	526.895,45	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	526.895,45	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	346.373,18	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	704.010,53	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	693.450,38	-	-	AA-

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/10/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	1.824.863,41	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	455.684,75	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	130.385,26	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	326.308,10	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.579.602,19	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	619.778,32	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	939.843,44	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	52.780,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	385.348,58	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	790.077,15	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	776.195,31	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	541.700,46	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	31.850,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	731.977,86	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	165.100,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	83.625,12	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.491.228,32	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.097.226,49	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.709.040,77	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.130.819,27	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	239.152,30	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.213.069,83	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	262.679,22	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.764.644,96	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.211.889,34	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.149.796,31	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.097.140,60	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	219.225,15	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.018.611,15	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	190.060,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	529.677,80	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	167.700,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	245.960,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	122.980,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.844.515,04	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	288.340,47	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.194.281,19	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	373.828,94	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	373.828,94	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.332.781,44	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	898.185,46	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.912.312,16	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	604.845,97	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	210.340,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.943.132,62	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	712.025,53	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.342.623,20	-	Aa2.br	-
FIM EMB I A	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.293.262,82	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.146.000,88	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	908.129,18	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.052.695,48	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.625.101,38	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.002.617,18	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.177.609,24	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	370.274,66	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	686.006,03	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.043.535,47	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.237.088,15	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.696.315,32	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.272.452,54	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	987.412,26	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.023.946,02	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	682.232,07	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	61.095,41	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	305.477,05	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	1.152.685,47	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	1.979.716,57	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	534.687,62	brAAA	-	-
FIM EMB I A	17/09/21	04/10/18	01/10/24	EQUATENE	1.413.544,65	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.059.003,60	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.083.400,92	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.083.400,92	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.086.452,73	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	812.023,74	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	812.023,74	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	269.943,03	-	-	AA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/10/2023

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	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	269.943,03	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	773.225,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	773.225,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	993.600,58	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	385.975,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	385.975,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.069.599,78	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.124.246,04	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	05/04/21	15/03/24	CCPR	40.610,32	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	28/12/20	15/01/26	LOCAMERI	1.893.290,49	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	2.432.947,42	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	845.996,73	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	673.731,57	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.833.076,70	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.715.864,08	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.507.377,31	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.288.380,62	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	859.538,09	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	170.385,98	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.940.484,35	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.217.993,36	brAAA	-	-
FIM EMB I A	28/10/21	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.835.973,17	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.350.104,06	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	370.774,91	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.092.771,12	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/11/21	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	4.034.921,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	12.016,46	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.201.207,45	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.338.402,52	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBBM	620.358,70	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.689.620,34	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.546.429,08	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.174.072,29	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	980.484,58	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.224.790,89	brAA	-	-
FIM EMB I A	19/01/22	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.279.410,19	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	350.697,90	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.090.421,68	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	357.210,63	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	346.047,80	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.099.387,57	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	826.049,59	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	736.746,93	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.073.069,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/04/22	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	283.269,19	BB-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	801.053,07	-	-	AAAs(f(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/24	LIGHT	977.035,87	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	270.892,84	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.251.436,09	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.855.434,86	-	A+ br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.500.124,60	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/05/22	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	507.840,53	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.507.085,12	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.424.853,33	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	567.653,40	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.153.737,03	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.109.029,88	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.512.113,41	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.035.361,27	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.257.517,36	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.607.409,83	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	837.052,22	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	454.122,72	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	525.028,63	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	273.975,22	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	1.821.119,28	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	894.360,21	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	72.966,45	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	755.426,94	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	854.234,27	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.280.047,34	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.405.565,09	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.138.746,21	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.023.709,68	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.517.259,06	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/07/22	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	1.514.768,29	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	10/01/22	10/01/28	AMBIPAR	2.449.958,04	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.375.250,61	-	-	AAA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2023



bradesco

RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/10/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.698.681,35	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.714.924,55	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.238,54	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	513.398,32	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.499.412,02	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.498.280,13	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	5.682.282,83	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.725.088,47	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	53.257,03	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.314.138,46	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/10/22	06/10/22	13/09/32	NTRASSUD	1.035.458,21	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	37.156,07	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	1.920.827,83	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/11/22	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	966.912,19	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	5.121.705,84	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.698.736,75	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.581.381,36	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.805.680,18	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	10.404.534,05	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.776.329,85	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.699.918,87	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.391.879,88	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.380.845,32	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.680.888,82	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.376.543,62	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.699.127,01	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.106.097,39	brAAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.234.237,48	brAAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.629.079,10	brAAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.134.582,08	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	1.170.269,35	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.965.862,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	3.192.772,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	3.212.769,73	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	26/01/23	20/01/26	HAPVIDA	492.202,74	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	AESTUCAN	1.144.449,65	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	ITAPOA T	3.553.134,50	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	BRV_VDR	8.485.585,91	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/03/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	977.878,73	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/04/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	692.775,12	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	26/01/23	20/01/26	VERO	2.871.585,86	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	1.101.879,08	-	A+ .br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	30.416,96	-	A+ .br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	2.167.671,91	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	PAMPASUL	1.786.287,84	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	LOCAMERI	2.156.980,68	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	MG050	3.285.954,99	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	BRK AMBI	1.274.094,53	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	VAMOS	1.747.025,31	brAAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	752.617,47	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	1.473.493,86	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	2.314.632,72	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	286.062,97	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	2.730.503,33	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CORSAN	1.548.331,75	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	636.281,44	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	METRRORIO	5.381.669,59	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HIDRO BR	2.560.623,46	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	213.761,17	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	26/01/23	20/01/26	BRK AMBI	2.228.839,52	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	2.098.612,47	brAAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	1.190.212,08	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	SABESP	2.382.641,82	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	CACHOEIR	1.915.484,42	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	COELBA	1.807.768,11	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	LOCAMERI	2.818.562,21	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	SMARTIF	3.236.780,20	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/05/23	26/01/23	20/01/26	UNIGEL P	71.256,07	BB-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	59.508,43	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/06/23	26/01/23	20/01/26	OURO VER	299.088,17	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/01/23	20/01/26	GBS PART	2.814.744,91	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/01/23	20/01/26	ASA BRAN	2.875.150,73	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/06/23	26/01/23	20/01/26	IGUA RJ	1.248.830,53	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	26/01/23	20/01/26	VAMOS	1.030.911,71	brAAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	26/01/23	20/01/26	1V11	385.450,02	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	1.494.322,73	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	963.172,12	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	963.172,12	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	1.494.322,73	brA	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/10/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	26/01/23	20/01/26	1V11	1.168.817,45	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	26/01/23	20/01/26	1V11	285.710,93	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/07/23	26/01/23	20/01/26	RD COLIN	1.622.511,40	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ECORODOV	1.442.694,20	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ECORODOV	1.442.694,20	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ITAPOA T	2.299.356,20	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ASA BRAN	2.829.996,44	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	01/08/23	26/01/23	20/01/26	TIMSA	2.520.743,99	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	26/01/23	20/01/26	VERO	1.267.674,63	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	26/01/23	20/01/26	TESC	1.965.403,22	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	26/01/23	20/01/26	RDVE	2.923.353,65	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	1.277.471,03	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	26/01/23	20/01/26	BRADESCO	3.975.901,20	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/08/23	26/01/23	20/01/26	SPERIO4	2.341.490,43	brAAA	-	-
FIM EMB II A	29/08/23	26/01/23	20/01/26	BRADESCO	10.212.800,31	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	30/08/23	26/01/23	20/01/26	VOLKSWAG	6.117.594,17	brAAA	AAA.br	-
FIM EMB II A	06/09/23	26/01/23	20/01/26	BTG PACT	10.194.404,40	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	08/09/23	26/01/23	20/01/26	B VOTORA	6.115.616,32	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/09/23	26/01/23	20/01/26	QUATA	2.477,07	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	26/01/23	20/01/26	ABC	5.080.436,10	brAAA	A+ .br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	26/01/23	20/01/26	PANAMERI	5.037.357,47	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/09/23	26/01/23	20/01/26	ELETRON	2.575.336,36	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/23	26/01/23	20/01/26	CSMG	2.460.136,06	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	26/01/23	20/01/26	SMARTIFI	2.510.090,26	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	26/01/23	20/01/26	RODO BR	2.505.698,94	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	26/01/23	20/01/26	S LUJZ A	1.463.218,75	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	26/01/23	20/01/26	B VOTORA	5.037.079,04	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/10/23	26/01/23	20/01/26	CORREDOR	2.281.884,56	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/10/23	26/01/23	20/01/26	SANTANDE	4.818.183,24	-	AAA.br	A-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN3	881.468,19	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.136.955,38	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	204.278,05	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	1.206.236,71	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.375.747,48	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	714.950,01	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	2.371.124,07	-	-	Aasf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.308.305,23	-	-	AAAs(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	1.751.159,46	-	AAA.br	-

Observação: Em outubro 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 **4.575.183.693,20**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.940.465.540,13	4.575.183.693,20	86,13%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do I	100,00%	3.209.748.948,51	4.575.183.693,20	70,16%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	730.716.591,62	3.660.147.009,10	15,97%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	915.036.752,28	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	icar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	457.518.376,14	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.143.795.923,30	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.143.795.923,30	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	533.733.798,66	3.202.628.530,70	11,67%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.143.795.923,30	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	75.382.482,29	915.036.752,28	1,65%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	25.026.249,48	686.277.581,25	0,55%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	915.036.752,28	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	457.518.376,14	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: 02 DE OUTUBRO DE 2023 À 31 DE OUTUBRO DE 2023



FIM EMB I A												
						FONTE ANBIMA						
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
17/10/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8895%	5,9412%	5,7397%	6,0727%	-0,0517%	NÃO
19/10/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	6,0010%	6,0901%	5,7509%	6,2437%	-0,0891%	NÃO
19/10/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,9405%	6,0665%	5,7810%	6,1146%	-0,1260%	NÃO
19/10/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,9505%	6,0665%	5,7810%	6,1146%	-0,1160%	NÃO
19/10/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,9405%	6,0665%	5,7810%	6,1146%	-0,1260%	NÃO
23/10/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,0095%	6,0330%	5,8683%	6,2021%	-0,0235%	NÃO
23/10/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,0095%	6,0330%	5,8683%	6,2021%	-0,0235%	NÃO
24/10/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,0295%	5,9976%	5,8740%	6,2080%	0,0319%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 02 DE OUTUBRO DE 2023 À 31 DE OUTUBRO DE 2023



FIM EMB II A												
						FONTE ANBIMA						
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
04/10/2023	FIM EMB II A	BNP	CAPITAL	LTN	01/04/2025	Venda	10,9252%	10,9260%	10,7735%	11,4811%	-0,0008%	NÃO
05/10/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2026	Venda	0,0595%	0,0563%	0,0436%	0,0873%	0,0032%	NÃO
05/10/2023	FIM EMB II A	BNP	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,9790%	6,0479%	5,7047%	6,2916%	-0,0689%	NÃO
05/10/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2025	Compra	6,0115%	6,0479%	5,7047%	6,2916%	-0,0364%	NÃO
05/10/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	6,0090%	6,0479%	5,7047%	6,2916%	-0,0389%	NÃO
09/10/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Compra	6,7826%	6,6611%	6,4091%	7,3129%	0,1215%	NÃO
10/10/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2026	Venda	0,0226%	0,0223%	0,0089%	0,0609%	0,0003%	NÃO
10/10/2023	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	LTN	01/07/2026	Compra	10,7474%	10,7415%	10,4339%	11,2734%	0,0059%	NÃO
17/10/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2026	Venda	0,0249%	0,0247%	0,0111%	0,0663%	0,0002%	NÃO
17/10/2023	FIM EMB II A	BNP	TERRA	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,6790%	5,7993%	5,4361%	5,9243%	-0,1203%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 02 DE OUTUBRO DE 2023 À 31 DE OUTUBRO DE 2023



FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO												
						FONTE ANBIMA						
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
04/10/2023	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,9590%	6,0000%	5,8581%	6,1918%	-0,0410%	NÃO



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE OUTUBRO DE 2023 à 31 DE OUTUBRO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
30-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	48,51	300,00	14.552,01	48,22	48,57	49,22	24.707,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	30,67	400,00	12.268,55	30,53	30,71	31,16	10.014,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	29,58	600,00	17.745,31	29,33	29,69	30,62	18.881,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,46	4.700,00	16.276,71	3,40	3,46	3,50	15.605,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,46	500,00	17.231,92	34,13	34,58	35,20	21.939,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	17,97	600,00	10.784,83	17,74	18,06	18,43	4.699,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,97	6.900,00	75.694,37	10,83	10,93	11,14	12.222,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	31,44	600,00	18.864,84	31,21	31,44	32,15	21.274,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,67	24.100,00	88.477,79	3,62	3,70	3,83	46.817,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,67	800,00	15.736,93	19,54	19,71	20,27	12.631,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,66	800,00	15.730,45	19,54	19,71	20,27	12.631,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	27,10	800,00	21.680,88	26,99	27,16	27,49	27.436,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	35,02	1.900,00	66.529,86	34,86	35,11	35,72	49.077,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	46,55	400,00	18.618,67	46,20	46,78	48,00	20.713,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,87	1.700,00	37.183,05	21,68	21,93	22,32	21.354,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,40	1.800,00	36.722,88	20,13	20,39	21,20	10.616,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	50,39	400,00	20.156,54	50,02	50,53	51,45	21.213,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	SRSP3	59,01	600,00	35.406,00	58,31	59,04	60,28	14.802,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	SRSP3	58,99	2.300,00	135.666,94	58,31	59,04	60,28	14.802,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,77	200,00	3.754,88	18,53	18,78	19,12	9.891,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,69	3.000,00	56.084,25	18,53	18,78	19,12	9.891,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,11	4.100,00	20.960,51	5,02	5,13	5,33	21.739,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,17	29.700,00	153.416,71	5,02	5,13	5,33	21.739,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,08	6.500,00	33.042,77	5,02	5,13	5,33	21.739,00
30-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	51,63	1.000,00	51.631,88	51,39	51,74	52,38	20.884,00
31-10-23	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	12,82	43.500,00	557.846,78	12,61	12,80	12,95	55.849,00
31-10-23	FIA RVA EMB II	Compra	ASAI3	11,08	45.400,00	503.139,97	10,86	11,10	11,49	22.883,00
31-10-23	FIA RVA EMB II	Compra	BRIT3	3,02	103.000,00	311.163,00	2,85	2,99	3,04	1.714,00
31-10-23	FIA RVA EMB II	Compra	CBAV3	3,80	110.000,00	417.539,32	3,72	3,79	3,84	7.094,00
31-10-23	FIA RVA EMB II	Compra	CRFB3	8,99	57.200,00	514.113,39	8,64	8,93	9,05	8.977,00
31-10-23	FIA RVA EMB II	Compra	DIRR3	17,38	19.500,00	338.850,86	17,01	17,31	17,53	8.619,00
31-10-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	26,76	7.600,00	203.376,00	26,66	26,85	27,18	29.397,00
31-10-23	FIA RVA EMB II	Venda	MRVE3	8,23	111.094,00	913.748,59	8,08	8,24	8,37	11.311,00
31-10-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	34,74	8.200,00	284.868,00	34,49	34,78	35,18	48.759,00
31-10-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	34,71	13.400,00	465.118,50	34,49	34,78	35,18	48.759,00
31-10-23	FIA RVA EMB II	Venda	YDUQ3	17,75	15.700,00	278.727,46	17,38	17,72	17,95	11.427,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	22,85	1.500,00	34.267,97	22,35	22,85	23,09	8.544,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	8,19	1.500,00	12.290,59	7,82	8,18	8,31	8.693,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	11,09	1.800,00	19.955,74	10,86	11,10	11,49	22.883,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,40	5.000,00	66.980,23	13,31	13,40	13,47	10.567,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,39	1.700,00	22.771,48	13,31	13,40	13,47	10.567,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	48,53	700,00	33.971,00	47,78	48,42	48,85	20.962,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	30,82	700,00	21.574,00	30,55	30,76	30,96	13.320,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	29,39	1.100,00	32.331,71	29,12	29,45	29,82	21.496,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	3,46	1.900,00	6.581,53	3,40	3,48	3,57	24.925,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,69	2.800,00	97.140,16	34,17	34,68	34,88	12.100,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,79	2.000,00	21.587,52	10,72	10,79	10,87	6.384,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	46,74	400,00	18.697,16	46,01	46,66	46,94	7.684,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	31,63	3.000,00	94.875,51	31,15	31,58	31,79	9.933,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,69	15.200,00	56.088,00	3,57	3,68	3,77	26.095,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,69	51.900,00	191.580,12	3,57	3,68	3,77	26.095,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,74	2.000,00	39.485,68	19,28	19,87	20,45	15.111,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	26,90	3.600,00	96.823,09	26,66	26,85	27,18	29.397,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	12,12	3.900,00	47.250,96	11,72	12,13	12,38	24.106,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	12,06	12.400,00	149.561,36	11,72	12,13	12,38	24.106,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	9,22	1.500,00	13.836,62	9,00	9,30	9,48	6.267,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	34,78	2.500,00	86.953,63	34,49	34,78	35,18	48.759,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	3,53	3.000,00	10.602,00	3,45	3,52	3,58	10.605,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	47,34	600,00	28.405,50	46,50	47,33	47,70	18.556,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	47,29	700,00	33.105,38	46,50	47,33	47,70	18.556,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,32	2.900,00	64.714,41	21,86	22,22	22,53	18.001,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,64	1.700,00	35.086,15	20,21	20,64	20,92	8.134,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,65	1.700,00	35.110,82	20,21	20,64	20,92	8.134,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	50,95	1.500,00	76.417,99	50,26	50,89	51,32	17.630,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBSP3	58,51	2.400,00	140.430,57	58,10	58,49	59,00	7.193,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBSP3	58,75	800,00	47.000,00	58,10	58,49	59,00	7.193,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,20	10.100,00	52.547,50	4,94	5,20	5,32	17.904,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,24	4.100,00	21.478,80	4,94	5,20	5,32	17.904,00
31-10-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	52,23	1.500,00	78.338,87	51,50	52,08	52,74	24.755,00

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.