



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Janeiro/2022





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 4.661/2018.

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 Risco



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.801.690.379,85	VAR / PL:	2,495%
VAR:	94.851.707,64	ETL / PL:	3,1288%
ETL:	118.947.908,83	VAR / CDI:	7179,98%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 152.906.812,50	BAIXA 1:	279.337.424,43	Cenário 1:	336.849.377,78
				Cenário 2:	- 74.108.977,90
				Cenário 3:	-519.785.163,10

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	337.064.854,80	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	1.812.664,44	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	20.132.492,87	1.870.065,53	604.129,34	-0,64%	68.383,41	267,06	93.299,84
AIEC11	2.156.156,80	281.425,37	25.118,51	0,03%	160.056,98	-	199.922,40
ALPA4	249.780,00	34.024,20	11.697,47	0,01%	16.895,34	68,19	24.940,45
ALSO3	2.621.376,00	316.840,73	250.814,29	0,26%	521.773,95	1.855,82	573.048,19
AMER3	6.560.198,37	1.064.948,29	53.405,16	0,06%	872.277,43	-	1.023.610,64
ASAI3	5.440.514,80	764.686,85	579.906,60	0,61%	608.616,27	-	730.105,71
AZUL4	456.685,15	101.536,74	38.172,93	0,04%	85.334,24	305,11	94.844,28
B3SA3	22.625.546,24	5.271.301,53	1.921.870,23	2,03%	9.999.563,25	32.307,84	8.866.189,10
Banco BTG Pactual SA UNT	20.435.067,60	3.554.903,59	2.349.847,39	2,48%	5.939.411,71	20.337,29	5.987.342,88
BBAS3	15.914.674,17	2.226.947,23	1.346.110,60	1,42%	4.753.590,45	16.224,43	4.757.499,92
BBDC3	1.327.035,60	165.651,85	30.657,34	0,03%	255.227,40	910,40	282.151,80
BBDC4	33.613.319,00	4.640.777,25	876.936,55	0,92%	6.981.470,90	24.739,89	7.603.487,68
BBRK3	22.875,00	6.226,84	1.429,85	0,00%	5.137,33	18,08	5.505,23
BBSE3	3.853.468,08	394.662,61	11.706,79	0,01%	538.159,00	1.964,45	627.188,04
BEEF3	125.378,40	23.772,48	3.953,82	0,00%	30.013,45	133,68	56.468,56
BIDI11	2.908.703,52	538.749,59	298.039,24	0,31%	929.989,54	3.147,70	913.560,78
BIDI3	351,56	59,14	31,34	0,00%	98,38	0,34	100,15
BIDI4	7.201,76	1.274,23	682,44	0,00%	2.198,23	7,48	2.187,24
BLCP11	1.260.750,36	288.789,65	38.174,09	0,04%	109.682,47	-	165.986,48
BMGB4	195.936,00	34.128,01	5.977,33	0,01%	6.460,29	25,61	9.133,35
BMLC11	2.030.004,00	76.744,22	26.326,82	0,03%	34.077,98	-	45.408,56
BPAN4	2.227.407,28	352.370,51	214.836,69	0,23%	516.048,95	1.810,29	549.293,30
BPML11	1.092.971,51	74.850,43	45.219,71	-0,05%	113.261,15	466,06	175.181,56
BRAP4	353.238,00	84.707,60	1.027,50	0,00%	61.084,42	261,37	103.973,41
BRFS3	959.311,55	193.549,13	52.620,53	-0,06%	129.982,86	544,39	209.883,34
BRKM5	684.350,00	174.743,40	53.903,50	0,06%	104.456,14	441,75	172.734,31
BRML3	9.437.619,44	1.689.767,61	955.913,13	1,01%	3.337.556,87	11.147,82	3.183.571,32
BRPR3	380.196,00	37.439,74	30.432,04	0,03%	58.482,88	212,14	67.179,90
CASH3	2.123.063,17	538.422,33	376.087,80	0,40%	463.198,71	-	499.413,76
CBOP11	49.790,70	8.810,85	482,72	0,00%	6.222,90	22,87	7.363,24
CCRO3	732.827,91	89.696,34	65.370,36	0,07%	170.771,12	598,72	181.540,76
CEOC11	825.662,20	77.427,82	11.690,29	0,01%	52.016,49	209,44	76.335,17
CESP6	10.990.645,78	1.677.081,34	227.367,03	-0,24%	2.498.279,54	8.779,98	2.670.258,76
CIEL3	75.167,04	6.883,58	3.865,50	0,00%	7.311,35	27,21	8.907,79
CLSA3	4.047.472,00	-	-	0,00%	-	-	-
CMIG4	750.501,94	47.431,03	41.551,10	0,04%	55.186,17	207,64	68.984,20
CMIN3	413.856,30	44.721,74	26.673,07	0,03%	13.562,37	-	17.742,78
CNES11	509.780,70	15.113,30	2.169,94	0,00%	2.146,41	8,35	2.902,34
CNRD11	78.302,00	-	-	0,00%	-	-	-
COGN3	239.362,20	41.594,55	32.337,22	0,03%	77.350,88	261,45	75.756,18



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.801.690.379,85	VAR / PL:	2,495%
VAR:	94.851.707,64	ETL / PL:	3,1288%
ETL:	118.947.908,83	VAR / CDI:	7179,98%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 152.906.812,50	BAIXA 1:	279.337.424,43	Cenário 1:	336.849.377,78
				Cenário 2:	- 74.108.977,90
				Cenário 3:	-519.785.163,10

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CPFE3	7.463.491,60	616.746,89	458.837,08	0,48%	892.170,90	3.286,31	- 1.061.675,12
CPLE6	571.594,23	59.264,25	36.794,71	0,04%	80.010,09	292,02	- 93.215,60
CRFB3	1.942.474,14	192.489,00	77.392,02	0,08%	248.294,33	911,17	- 292.927,16
CSAN3	1.401.907,21	143.247,74	123.851,50	0,13%	238.683,13	859,57	- 269.682,95
CSED3	2.625.275,00	631.973,01	330.581,50	0,35%	- 56.252,00	-	- 78.420,05
CSNA3	852.295,34	152.078,69	80.619,93	0,08%	62.145,33	233,89	- 77.735,82
CVCB3	157.889,55	31.339,49	25.567,80	0,03%	55.218,40	184,72	- 52.847,82
CYRE3	4.813.311,36	863.854,59	677.637,76	0,71%	1.268.770,27	4.392,40	- 1.310.888,63
DXCO3	232.409,40	36.295,01	23.151,67	0,02%	25.640,38	-	- 30.808,71
ECOR3	136.097,75	22.698,12	11.541,40	0,01%	51.907,67	171,54	- 48.363,12
EGIE3	5.487.860,52	241.829,72	84.071,52	0,09%	471.540,18	1.763,93	- 581.548,86
ELET3	2.613.919,11	308.524,12	244.379,39	0,26%	570.685,25	2.013,22	- 615.215,34
ELET6	7.697.729,55	880.370,29	700.381,50	0,74%	1.489.158,62	5.309,29	- 1.644.441,29
ENBR3	255.321,24	19.003,22	3.426,47	0,00%	34.698,09	126,87	- 40.594,82
ENEV3	4.727.772,49	515.595,44	287.682,52	0,30%	454.934,09	1.693,71	- 554.887,35
ENGI1	554.527,61	53.494,38	39.365,77	0,04%	66.951,28	246,48	- 79.571,67
ENJU3	93.960,00	20.359,23	9.979,14	0,01%	34.305,69	-	- 30.404,90
EQTL3	13.828.232,70	709.504,37	594.235,72	0,63%	1.049.079,44	3.942,84	- 1.308.039,08
ESPA3	39.270,00	6.074,91	3.109,97	0,00%	- 2.118,79	-	- 3.074,20
EUCATEX PN	130.130,00	13.370,49	8.586,71	0,01%	4.622,39	17,71	- 6.028,27
EWJ_US	3.998.409,54	382.821,51	110.004,71	-0,12%	- 498.088,11	- 35.985,69	- 792.341,13
EZTC3	82.513,70	13.642,31	11.640,05	0,01%	16.774,41	59,55	- 18.347,00
FLRY3	310.109,30	49.628,56	23.191,42	0,02%	88.754,52	304,45	- 89.829,97
GALG11	1.255.224,18	47.691,14	10.945,76	0,01%	- 17.018,22	-	- 23.501,55
GALG13	492,10	4,49	0,64	0,00%	-	-	-
GGBR4	8.594.921,72	896.885,92	609.613,26	0,64%	963.139,89	3.559,80	- 1.155.164,35
GGPS3	4.053.570,22	620.598,26	460.697,80	0,49%	576.929,79	-	- 670.533,77
GMAT3	6.247.581,60	710.542,35	142.508,37	0,15%	644.369,48	2.391,35	- 780.170,40
GNDI3	16.340.492,50	3.186.524,00	1.145.255,33	1,21%	5.650.563,66	18.930,96	- 5.426.263,17
GOAU4	1.458.584,68	128.015,00	90.262,29	0,10%	156.256,67	578,83	- 188.388,68
GOLL4	147.374,64	24.178,65	18.674,94	0,02%	18.075,15	66,49	- 21.439,48
GSFI11	498.474,40	31.240,68	5.956,13	0,01%	-	-	-
HAPV3	9.359.929,20	2.101.179,63	769.447,72	0,81%	3.950.093,90	12.856,61	- 3.559.121,98
HBRH11	2.092.360,00	314.702,53	66.191,09	0,07%	- 69.751,47	-	- 98.656,34
HBSA3	380.729,95	76.417,48	29.668,21	0,03%	- 47.365,91	- 197,15	- 75.331,31
HSML11	8.442.274,20	1.023.272,91	152.376,46	-0,16%	- 1.054.730,46	- 4.391,38	- 1.678.655,39
HYPE3	5.167.562,40	480.098,89	346.221,30	0,37%	760.904,69	2.768,16	- 879.922,27
IGTI11	1.007.672,32	190.471,24	106.915,25	0,11%	-	-	-
INTB3	5.791.170,00	839.532,18	558.258,62	0,59%	1.319.674,88	-	- 1.409.760,66
IRBR3	205.398,27	31.224,14	4.869,43	0,01%	- 11.653,30	- 46,77	- 16.967,06
ITSA4	17.365.543,81	2.400.850,21	508.338,51	0,54%	2.865.955,96	10.344,79	- 3.255.139,60
ITUB4	36.493.755,64	7.009.062,36	978.629,05	1,03%	6.624.229,39	23.739,31	- 7.401.321,39
JBS3	16.838.180,94	1.546.545,95	437.864,88	-0,46%	- 1.754.568,98	- 7.222,17	- 2.715.868,45
JHSF3	81.641,60	15.045,83	12.238,59	0,01%	23.504,49	80,57	- 23.752,94



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.801.690.379,85	VAR / PL:	2,495%
VAR:	94.851.707,64	ETL / PL:	3,1288%
ETL:	118.947.908,83	VAR / CDI:	7179,98%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 152.906.812,50	BAIXA 1:	279.337.424,43	Cenário 1:	336.849.377,78
				Cenário 2:	- 74.108.977,90
				Cenário 3:	-519.785.163,10

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
JRDM11	1.138.839,70	139.913,27	22.426,32	-0,02%	168.548,40	710,92	276.915,71
KLBN11	1.044.102,94	113.753,67	30.171,63	0,03%	74.471,48	301,17	110.449,69
LCAM3	2.044.757,82	319.607,03	264.434,84	0,28%	419.380,28	1.487,78	457.894,26
LREN3	12.225.263,50	2.840.564,41	788.463,42	0,83%	6.303.605,50	19.835,18	5.277.360,50
LVBI11	3.983.110,64	462.869,80	100.395,75	0,11%	205.398,96	822,08	297.131,07
LWSA3	2.354.412,96	693.070,19	112.012,88	0,12%	278.530,34	1.155,40	439.333,73
MALL11	7.714.933,07	803.395,39	176.537,22	0,19%	346.264,73	1.381,08	496.763,47
MATD3	2.721.668,65	1.103.883,57	440.566,69	0,46%	465.073,83	-	525.150,73
MAXR11	1.433.971,95	90.428,33	3.260,96	0,00%	24.625,40	96,84	34.154,50
MDNE3	102.853,00	27.010,78	19.042,95	0,02%	39.220,43	129,62	36.544,53
MEGA3	2.493.467,88	17.093.039,14	4.407.505,81	-4,65%	-	-	-
MGLU3	6.381.968,23	2.461.920,87	321.100,38	-0,34%	805.857,97	2.959,35	952.252,20
MOVI3	7.398.830,00	1.590.657,38	1.128.185,57	1,19%	2.231.243,04	7.606,68	2.227.352,94
MRFG3	406.801,68	43.570,15	18.785,02	-0,02%	8.925,69	35,18	12.450,89
MRVE3	435.428,51	65.666,21	52.568,80	0,06%	125.300,74	429,54	126.640,55
MULT3	8.539.437,06	1.429.253,66	770.810,26	0,81%	3.392.159,94	11.143,38	3.119.142,34
NEWU11	376.027,26	174.303,36	22.776,73	0,02%	67.733,96	-	116.501,37
NINJ3	59.690,00	22.514,60	528,36	0,00%	9.088,94	-	15.022,22
NTCO3	11.991.474,50	2.176.089,77	245.190,52	0,26%	231.332,24	893,33	307.355,80
PACUCAR_CBD ON ED	176.279,44	20.080,04	12.457,32	0,01%	19.720,94	72,90	23.657,41
PARD3	819.587,60	147.104,53	81.779,79	0,09%	301.508,36	1.001,57	284.135,40
PATC11	8.302.136,15	431.934,51	42.129,15	-0,04%	20.081,02	78,19	27.210,44
PETR3	27.789.806,45	3.706.371,27	2.956.347,51	3,12%	6.251.529,55	21.992,15	6.696.828,92
PETR4	49.437.306,12	6.770.579,52	5.377.682,83	5,67%	12.638.667,33	43.897,22	13.154.390,99
PETZ3	265.555,96	54.943,97	39.942,56	0,04%	126.365,66	403,29	109.081,49
POSI3	36.652,50	8.389,04	4.623,35	0,00%	791,37	3,12	1.103,45
POWE3	36.505,00	5.161,18	994,04	0,00%	2.436,73	-	3.068,74
PRI03	17.062.478,72	4.351.748,21	59.209,82	-0,06%	5.832.674,95	19.571,20	5.620.298,74
QAGR11	8.606.891,60	571.094,06	888,35	0,00%	52.714,44	-	71.119,65
QUAL3	382.543,09	54.461,25	24.616,69	0,03%	76.235,33	271,12	83.707,38
RADL3	7.013.301,20	1.021.484,23	300.360,97	0,32%	309.439,06	1.233,71	443.514,31
RAIL3	11.930.650,96	1.389.294,63	760.492,44	0,80%	300.612,11	1.157,52	396.694,88
RAPT4	3.120.180,00	373.430,46	169.859,28	0,18%	585.501,75	2.092,71	650.244,75
RBRL11	1.875.109,62	257.391,35	51,69	0,00%	97.155,84	-	140.589,22
RCRB11	1.537.176,30	158.423,79	88.614,18	0,09%	101.703,58	383,99	128.165,14
RDOR3	1.278.965,26	151.906,78	56.527,62	0,06%	229.851,57	-	257.273,22
RECV3	1.762.146,00	481.001,49	116.023,42	0,12%	122.044,28	-	153.275,06
RENT3	7.938.322,88	1.250.028,78	1.047.506,58	1,10%	1.654.471,64	5.861,08	1.800.632,08
RNGO11	135.380,54	8.300,96	2.195,22	0,00%	1.104,05	4,32	1.514,86
RRRP3	388.495,56	101.726,79	4.723,71	0,00%	30.865,37	115,81	38.334,36
SANB11	620.061,68	75.774,24	1.943,50	0,00%	98.391,09	356,14	112.469,19
SBSP3	639.261,00	109.021,56	44.281,15	0,05%	38.131,87	153,26	55.723,30
SDIL11	363.213,50	23.946,73	3.109,65	0,00%	15.511,28	61,80	22.193,19
SEER3	854.283,36	131.937,54	94.094,71	0,10%	266.710,64	905,42	263.742,37
SOMA3	3.341.617,10	661.359,20	459.211,10	0,48%	1.407.103,34	4.581,38	1.268.796,85



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.801.690.379,85	VAR / PL:	2,495%
VAR:	94.851.707,64	ETL / PL:	3,1288%
ETL:	118.947.908,83	VAR / CDI:	7179,98%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 152.906.812,50	BAIXA 1:	279.337.424,43	Cenário 1:	336.849.377,78
				Cenário 2:	- 74.108.977,90
				Cenário 3:	-519.785.163,10

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
SPY	12.602.066,80	1.855.347,62	540.653,75	-0,57%	2.017.003,39	118.803,29	3.370.550,20
STBP3	6.586.625,00	1.304.671,96	1.185.806,26	1,25%	1.201.157,38	4.303,02	1.340.944,19
SULA11	2.224.188,82	246.965,35	46.454,40	0,05%	111.331,92	423,57	142.831,77
SUZB3	20.521.773,10	1.820.018,15	647.708,66	0,68%	702.397,08	2.786,18	994.551,99
TAAE11	420.958,20	19.516,59	11.215,83	0,01%	19.144,57	73,00	24.687,77
TEND3	1.889.450,00	264.661,91	114.533,64	0,12%	379.427,88	1.348,51	415.998,19
TEPP11	8.138.639,25	769.200,24	327.590,83	0,35%	152.085,10	598,52	211.320,56
TIMS3	2.820.921,39	278.071,08	32.540,16	0,03%	182.351,38	688,98	230.181,71
TOTS3	5.805.436,62	734.086,12	365.132,60	0,38%	1.139.780,64	4.058,65	1.255.102,16
TRXF11	13.418.769,00	635.808,32	126.901,75	0,13%	266.639,35	1.049,96	371.020,88
UGPA3	3.409.362,72	523.923,75	442.283,49	0,47%	607.743,30	2.181,06	681.232,27
USIM5	7.819.604,20	1.310.209,64	791.753,54	0,83%	984.423,87	3.615,72	1.163.715,78
VALE3	76.568.476,44	10.645.664,82	4.567.498,80	4,82%	2.881.527,31	11.028,65	3.748.934,12
VBBR3	12.048.915,84	1.390.426,48	1.145.056,02	1,21%	2.716.085,76	-	2.908.270,39
VIIA3	377.212,37	54.193,25	28.644,06	0,03%	66.309,56	-	74.510,09
VISC11	6.633,00	473,07	9,00	0,00%	342,79	1,37	495,95
VITT3	531.031,17	151.138,18	15.098,65	-0,02%	117.150,35	-	214.067,23
VIVT3	1.097.522,46	91.002,65	17.736,07	-0,02%	28.778,21	110,76	37.931,76
VTV_US	7.890.120,47	1.157.319,60	454.422,65	-0,48%	388.109,89	71.011,08	559.780,55
VVPR11	1.253.996,96	89.354,60	17.313,92	0,02%	18.921,88	-	26.178,39
WEGE3	11.458.898,28	1.316.358,76	842.320,81	0,89%	1.294.375,36	4.782,10	1.550.969,99
WEST3	97.310,00	49.850,42	29.186,35	0,03%	35.927,02	-	33.819,02
WSPH22	2.977.754,98	452.064,59	131.094,28	-0,14%	184.045,67	26.799,79	269.683,88
XPIN11	3.813.979,38	393.117,96	71.707,18	0,08%	248.972,02	-	366.426,18
XPPR11	3.402.428,00	376.359,54	67.038,46	0,07%	251.611,52	-	374.422,03
YDUQ3	1.616.708,86	277.467,90	214.303,22	0,23%	571.360,38	1.908,58	545.108,71
INDG22	-	888.008,46	603.365,23	0,64%	-	-	-
WING22	-	262.850,50	178.596,11	0,19%	-	-	-
DI1G22	-	14.223,51	2.598,03	0,00%	16.689,10	8.665,00	25.690,80
DI1J22	-	4.725,14	1.670,45	0,00%	23.035,06	11.915,28	35.239,87
DI1N22	-	351.705,58	177.466,13	0,19%	842.945,00	434.167,63	1.280.419,26
DAPQ22	-	143.274,51	34.206,21	0,04%	121.416,46	44.072,35	265.039,76
DI1V22	-	7.794,86	4.453,74	0,00%	13.339,44	6.843,32	20.128,58
DI1F23	-	2.951.491,03	1.763.936,27	1,86%	4.553.052,07	2.327.335,06	6.829.067,08
DAPK23	-	398.199,76	170.051,90	0,18%	373.911,72	135.062,59	806.923,51
DI1N23	-	62.599,66	43.946,63	0,05%	93.351,90	47.407,37	138.506,73
DI1F24	-	441.563,24	331.450,31	0,35%	630.780,56	318.490,68	926.968,08
DI1N24	-	27.664,37	20.801,57	0,02%	38.639,04	19.399,22	56.250,86
DAPQ24	-	376.613,16	228.452,71	0,24%	611.246,20	219.427,23	1.300.109,02
DI1F25	-	582.063,54	431.811,90	0,46%	805.911,94	402.186,28	1.161.586,17
DAPK25	-	128.339,95	104.196,99	0,11%	-	-	-
DI1F26	-	367.197,90	256.936,61	-0,27%	504.472,35	248.615,29	712.184,85
DAPQ26	-	100.788,90	78.039,89	0,08%	-	-	-
DI1F27	-	330.390,70	219.549,29	0,23%	467.680,99	227.511,89	646.273,40
DAPQ28	-	247.749,67	168.046,77	-0,18%	-	-	-



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.801.690.379,85	VAR / PL:	2,495%
VAR:	94.851.707,64	ETL / PL:	3,1288%
ETL:	118.947.908,83	VAR / CDI:	7179,98%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 152.906.812,50	BAIXA 1:	279.337.424,43	Cenário 1:	336.849.377,78
				Cenário 2:	- 74.108.977,90
				Cenário 3:	- 519.785.163,10

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DI1F29	-	266.886,86	163.788,84	0,17%	394.024,52	- 186.687,48	- 521.413,49
DAPQ30	-	1,48	0,90	0,00%	3,06	1,06	6,00
DI1F31	-	31.980,90	18.363,40	0,02%	49.732,72	- 22.954,97	- 63.062,61
DAPK35	-	17.696,60	9.187,39	-0,01%	-	-	-
DOLG22	-	221.163,57	39.368,41	0,04%	233.699,26	33.894,91	- 342.504,93
WDOG22	-	227.482,53	40.493,22	-0,04%	- 240.376,38	- 34.863,34	352.290,79
DOLH22	-	350.158,16	61.731,18	0,07%	376.356,88	50.017,73	- 553.708,80
WDOH22	-	108.230,70	19.080,55	0,02%	116.328,49	15.460,02	- 171.146,36
EMP AÇÃO PROVISÃO	38.301,00	175,71	117,34	0,00%	462,77	- 196,25	- 523,92
LTN	5.477.668,64	93.753,91	65.817,75	0,07%	139.810,76	- 71.000,81	- 207.437,99
DE252 AEGEA SA CDI - AEGP13	1.042.830,40	142,23	43,92	0,00%	102,24	- 52,35	- 153,83
DE252 AERIS CDI - AERI11	1.239.964,23	1.203,17	901,07	0,00%	1.846,07	- 931,27	- 2.709,09
DE252 ALIANSCA CDI - ALSA0	4.077.479,14	48.043,43	32.313,83	0,03%	64.756,26	- 31.683,39	- 90.322,21
DE252 AUTOBAN CDI - ANHB10	935.597,23	343,51	254,78	0,00%	510,89	- 257,05	- 746,53
DE252 AUTOPIST CDI - APRB28	1.398.736,74	635,56	483,02	0,00%	958,48	- 479,39	- 1.386,84
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.747.447,58	398,15	227,57	0,00%	495,66	- 252,13	- 737,53
DE252 BCBF CDI - BCBF14	274.509,79	196,41	144,40	0,00%	299,72	- 151,52	- 441,42
DE252 BCBF CDI - BCBF15	2.647.811,73	2.052,82	1.523,75	0,00%	3.163,44	- 1.598,16	- 4.653,59
DE252 BKBR CDI - BKBR18	1.473.005,77	579,09	402,40	0,00%	833,63	- 422,68	- 1.233,71
DE252 BRKA CDI - BRKP18	2.706.537,70	3.494,64	2.615,66	0,00%	5.326,78	- 2.689,33	- 7.827,40
DE252 BRML CDI - BRML17	3.231.902,78	6.874,53	4.991,77	-0,01%	- 9.340,18	4.687,19	13.588,36
DE252 CCPR CDI - CCPRA3	2.182.615,82	4.204,44	1.864,80	0,00%	- 3.334,07	1.561,08	4.311,78
DE252 CEA MODA CDI - CEAB11	2.141.602,01	1.366,58	995,36	0,00%	2.069,45	- 1.047,30	- 3.053,01
DE252 CELPA CDI - CELP15	2.594.794,85	319,11	83,48	0,00%	212,83	- 109,29	- 321,71
DE252 CONT GLO CDI - CGBP13	2.434.810,33	4.450,38	3.272,89	0,00%	6.763,65	- 3.338,19	- 9.575,12
DE252 COPEL GT CDI - CPGT14	290.041,82	719,59	495,64	0,00%	- 1.188,51	610,49	1.797,27
DE252 COPEL GT CDI - CPGT16	290.162,84	500,98	379,35	0,00%	- 741,54	376,72	1.100,99
DE252 CORSAN CDI - RSAN24	1.637.108,80	25.364,28	18.190,90	0,02%	33.813,93	- 16.878,83	- 48.729,17
DE252 COSAN LO CDI - RLOG11	1.674.794,66	1.079,17	783,77	0,00%	1.639,02	- 828,96	- 2.415,58
DE252 CSAN CDI - CSAN23	1.159.736,79	4.479,98	3.107,40	0,00%	6.814,73	- 3.303,86	- 9.369,49
DE252 DASA CDI - DASAA2	2.680.711,48	758,22	488,16	0,00%	1.040,21	- 528,18	- 1.543,13
DE252 ECORODOV CDI - ERDV18	1.837.089,21	34.388,82	21.863,81	0,02%	49.917,65	- 23.892,24	- 67.165,98
DE252 ECORODOV CDI - ERDVA0	2.106.533,74	599,70	284,29	0,00%	785,55	- 402,34	- 1.182,20
DE252 ELEKTRO CDI - ELEK27	562.105,76	900,07	626,10	0,00%	- 1.376,17	705,13	2.072,36
DE252 ELETROB CDI - ELET13	2.111.750,39	2.386,01	1.816,05	0,00%	3.573,83	- 1.791,85	- 5.191,64
DE252 ENER TR CDI - ETEN13	7.601.287,31	168.902,08	118.556,18	0,12%	266.959,21	- 128.975,81	- 365.053,61
DE252 ENERSUL CDI - ESUL18	1.015.409,82	418,45	259,45	0,00%	- 840,21	435,23	1.288,43
DE252 EQUATENE CDI - EQTL13	1.480.661,66	549,37	377,60	0,00%	782,09	- 396,65	- 1.157,94
DE252 GUAR CDI - GUAR24	2.743.485,92	2.670,98	1.983,80	0,00%	4.124,26	- 2.084,29	- 6.070,45
DE252 GUARIROB CDI - GRRB14	1.060.861,24	513,13	389,11	0,00%	760,26	- 381,53	- 1.106,11
DE252 IGUAATEMI CDI - IGTA19	2.359.635,58	495,13	208,56	0,00%	617,03	- 316,53	- 931,07
DE252 IGUAATEMI CDI - IGTA37	2.157.103,23	4.870,09	3.607,54	0,00%	- 6.704,18	3.382,62	9.841,15
DE252 INTERVIA CDI - IVIA35	1.326.676,13	554,85	395,60	0,00%	814,77	- 412,37	- 1.202,18
DE252 LIGHT CDI - LIGHD3	1.669.592,30	3.984,46	2.907,36	0,00%	5.960,61	- 2.941,74	- 8.437,10
DE252 LOCAMERI CDI - LCAMA9	1.930.973,27	2.050,79	1.551,20	0,00%	3.105,64	- 1.564,06	- 4.544,86



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.801.690.379,85	VAR / PL:	2,495%
VAR:	94.851.707,64	ETL / PL:	3,1288%
ETL:	118.947.908,83	VAR / CDI:	7179,98%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 152.906.812,50	BAIXA 1:	279.337.424,43	Cenário 1:	336.849.377,78
				Cenário 2:	- 74.108.977,90
				Cenário 3:	-519.785.163,10

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 MOV_PART CDI - MOV116	1.118.359,05	1.450,48	1.099,09	0,00%	2.236,77	- 1.121,30	- 3.248,68
DE252 MOV_PART CDI - MOV127	1.218.684,24	4.555,50	3.277,53	0,00%	6.816,01	- 3.350,75	- 9.586,30
DE252 MOV_PART CDI - MOV133	1.464.602,27	135,45	12,80	0,00%	0,02	-	0,02
DE252 MULTIPLA CDI - MULP16	3.161.799,71	5.185,72	3.860,63	0,00%	- 7.219,71	3.657,15	10.667,39
DE252 OMEGA GE CDI - OMGE13	3.351.789,51	6.456,87	4.735,47	0,00%	9.754,80	- 4.813,02	- 13.802,41
DE252 OURO VER CDI - OVSA10	1.544.109,35	2.006,65	1.524,34	0,00%	3.031,10	- 1.522,00	- 4.414,10
DE252 PROLAGOS CDI - PRLG14	3.132.753,54	40.475,09	30.372,59	-0,03%	- 58.057,47	29.365,26	85.567,52
DE252 RD COLIN CDI - RDCO10	3.233.391,39	54.793,02	38.277,52	0,04%	73.415,25	- 36.652,95	- 105.766,66
DE252 RENNEN CDI - LRENB1	1.429.568,24	592,27	408,68	0,00%	857,02	- 434,37	- 1.267,52
DE252 RT BANDE CDI - CBAN22	3.245.783,79	3.962,39	3.005,76	0,00%	6.010,84	- 3.006,04	- 8.695,49
DE252 S LUIZ A CDI - RDORB9	1.146.815,09	4.253,00	2.949,98	0,00%	6.470,98	- 3.136,96	- 8.895,77
DE252 SANEAMEN CDI - SNGO18	2.602.118,24	1.719,47	1.260,90	0,00%	2.628,58	- 1.328,78	- 3.870,78
DE252 SBF COME CDI - SBFC11	4.096.991,47	56.093,65	42.129,43	0,04%	74.620,81	- 37.716,77	- 109.745,97
DE252 SIMPAR CDI - JSMLA5	1.193.891,39	7.036,10	4.918,32	0,01%	10.619,67	- 5.170,27	- 14.701,34
DE252 SUL AME CDI - SULM15	667.939,42	369,29	231,47	0,00%	668,96	345,03	1.018,45
DE252 TELEF BR CDI - VIVT15	5.115.766,48	41.217,67	25.270,53	0,03%	45.368,01	- 23.850,16	- 71.178,96
DE252 USIMINAS CDI - USIM17	3.428.097,61	14.733,05	10.316,21	0,01%	19.827,76	- 10.164,97	- 29.873,54
DE252 VAMOS CDI - VAMO22	1.122.399,21	1.040,94	787,69	0,00%	1.577,81	- 792,85	- 2.300,59
DE252 VAMOS CDI - VAMO23	294.533,26	1.503,78	1.043,22	0,00%	2.279,53	- 1.106,55	- 3.140,62
DE252 VIX LOGI CDI - VIXL14	2.148.567,44	2.024,05	1.521,81	0,00%	3.084,57	- 1.554,55	- 4.519,40
LF selic	8.831.841,17	13.481,60	10.005,71	-0,01%	- 18.343,29	9.549,47	28.364,49
LF252 ABC CDI - LF002100BMM	1.057.934,55	97,84	9,25	0,00%	0,01	-	0,02
LF252 ABC CDI - LF002100BMX	1.057.934,55	97,84	9,25	0,00%	0,01	-	0,02
LF252 B.ALFA CDI - LF002100G50	1.029.570,22	95,21	9,00	0,00%	0,01	0,00	0,02
LF252 BES INV CDI - LF00220018H	1.034.933,51	95,71	9,05	0,00%	0,01	0,00	0,02
LF252 CNH CDI - LF0021003Q1	1.969.999,06	182,18	17,22	0,00%	0,02	- 0,00	0,03
LF252 DAYCOVAL CDI - LF002100HDP	1.226.153,53	113,39	10,72	0,00%	0,01	-	0,02
LF252 DAYCOVAL CDI - LF002100HDQ	2.233.732,12	206,57	19,53	0,00%	0,02	0,00	0,03
LF252 PANAMERI CDI - LF002100E1F	1.056.016,28	97,66	9,23	0,00%	0,01	0,00	0,02
LF252 PARANA B CDI - LF002100BC4	1.595.372,04	147,54	13,95	0,00%	0,02	0,00	0,02
LFSN BRADESCO CDI - LFSN210029N	3.476.750,94	321,53	30,39	0,00%	0,04	-	0,05
LFT	126.016.101,88	34.866,27	1.206,28	0,00%	1,38	-	1,87
LFV TOYOTA CDI - LF002100ISJ	2.290.026,31	211,78	20,02	0,00%	0,03	- 0,00	0,03
CMTR33	5.463.247,74	23.096,09	3.720,20	0,00%	1.822,59	- 665,05	- 4.027,65
CRI RB CAPIT IPCA M D - 17H0164854	7.546.133,20	88.683,18	64.886,47	0,07%	175.454,85	- 62.385,82	- 355.721,09
CRI REIT SEC IPCA - 21K0001807	2.542.490,52	90.787,93	50.631,04	0,05%	180.986,45	- 59.448,69	- 315.020,93
DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23	12.069.095,50	150.750,55	100.838,97	0,11%	272.305,24	- 98.019,69	- 564.193,18
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.689.175,13	58.249,34	28.277,63	0,03%	89.443,07	- 31.977,90	- 187.865,86
DE252 CEMIG - IPCA CMDT33	2.594.683,14	24.382,92	14.675,34	0,02%	34.789,19	- 12.506,76	- 74.248,29
DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17	36.584.519,66	755.738,25	331.907,25	0,35%	1.863.439,71	- 8.218,36	- 38.648.364,39
DE252 CSAN IPCA - CSAN33	5.561.439,63	124.460,93	87.497,34	0,09%	277.327,85	- 93.974,12	- 522.393,69
DE252 CSMG IPCA - CSMGC3	12.073.118,06	144.085,10	84.220,22	0,09%	227.348,54	- 81.600,35	- 475.795,61
DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24	14.232.479,43	99.359,63	24.764,47	0,03%	131.864,68	- 47.671,56	- 285.135,88
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	10.540.133,56	129.614,90	85.121,41	0,09%	229.115,07	- 82.641,28	- 474.539,33
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36	3.126.116,75	38.832,90	18.851,75	0,02%	59.628,71	- 21.318,60	- 125.243,91



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.801.690.379,85	VAR / PL:	2,495%
VAR:	94.851.707,64	ETL / PL:	3,1288%
ETL:	118.947.908,83	VAR / CDI:	7179,98%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 152.906.812,50	BAIXA 1:	279.337.424,43	Cenário 1:	336.849.377,78
				Cenário 2:	- 74.108.977,90
				Cenário 3:	-519.785.163,10

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	983.469,12	13.061,60	5.508,85	0,01%	9.951,50	3.600,94	21.564,32
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	468.138,85	2.824,95	816,30	0,00%	529,11	193,28	1.172,20
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	616.522,19	3.539,49	1.225,54	0,00%	2.724,87	990,30	5.965,16
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	1.015.950,47	9.421,59	3.390,57	0,00%	7.545,91	2.735,63	16.423,76
DE252 IMED - IPCA SULM23	1.046.120,15	5.863,69	1.909,34	0,00%	2.082,97	759,60	4.596,44
DE252 IRB IPCA - IRBR12	9.376.045,47	146.820,23	114.877,35	0,12%	300.687,25	107.277,36	603.103,98
DE252 LIGHT IPCA - LIGHD7	4.721.545,64	73.302,08	56.266,51	0,06%	146.539,65	51.572,15	299.674,14
DE252 LIGHT IPCA - LSVE29	4.419.420,02	33.521,79	7.651,81	0,01%	31.132,37	11.195,29	67.137,95
DE252 LOCALIZA IPCA - LORTA7	8.701.902,53	200.744,50	137.636,04	0,15%	451.394,59	151.358,47	850.129,25
DE252 LOCAMERI IPCA - LCAMD1	10.155.083,37	236.935,55	165.897,76	0,17%	523.586,18	180.491,93	973.528,24
DE252 MOV_PART IPCA - MOVI37	2.996.523,81	71.874,24	50.569,03	0,05%	155.706,01	54.947,92	285.091,97
DE252 MOVIDA L IPCA - MVLV16	6.055.222,69	168.045,12	118.167,24	0,12%	343.814,66	120.769,75	695.273,22
DE252 PETR IPCA - PETR45	14.105.677,58	177.118,11	76.119,41	0,08%	244.897,65	87.786,66	519.316,54
DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34	8.479.232,38	49.864,70	13.421,53	0,01%	49.127,02	19.259,10	99.680,60
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	4.924.985,29	65.409,49	27.587,07	0,03%	49.834,81	18.032,67	107.989,12
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	14.259.810,28	168.662,02	103.156,49	0,11%	268.545,74	96.230,46	563.706,78
DE252 SIMPAR IPCA M D - JSMLB5	922.731,16	22.458,95	15.822,86	0,02%	48.365,81	17.174,66	88.184,07
DE252 TRANS AL - IPCA TAEE33	11.342.440,82	129.248,50	60.877,60	0,06%	178.340,04	64.196,59	381.773,27
DE252 VAMOS IPCA - VAMO33	5.669.701,41	134.190,18	94.788,35	0,10%	297.825,33	102.499,38	557.276,67
DE252 VAMOS IPCA - VAMO34	2.347.203,14	58.268,52	40.956,98	0,04%	126.151,91	44.533,92	230.418,25
DEBI AESTUCAN IPCA - TCII11	4.854.297,37	153.777,62	94.300,20	0,10%	323.937,50	107.143,94	573.827,24
DEBI ANEMUS IPCA - ANEM11	12.796.602,46	354.452,19	235.279,27	0,25%	758.563,68	261.008,88	1.334.552,05
DEBI ANET IPCA - ANET11	6.537.339,34	88.021,88	67.752,76	0,07%	187.720,81	65.717,81	377.813,46
DEBI B2W IPCA - BTOW15	6.687.148,61	168.788,97	116.690,23	0,12%	368.800,40	128.168,56	678.905,71
DEBI BRISANET IPCA - BRST11	5.570.524,37	84.716,75	66.088,30	0,07%	177.275,54	62.309,30	356.008,56
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	6.985.800,61	173.986,16	108.765,95	0,11%	383.270,26	122.270,14	725.838,19
DEBI CAGECE IPCA - CAEC21	4.873.652,54	68.631,07	34.126,82	0,04%	122.100,41	29.516,08	295.395,54
DEBI CART IPCA - CART13	4.534.495,61	110.794,54	75.246,95	0,08%	240.738,52	83.004,53	439.850,61
DEBI CEEE D IPCA - CEED21	4.131.459,69	81.377,79	60.899,75	0,06%	180.596,92	61.684,74	349.997,52
DEBI CELP IPCA - CEPEC1	2.154.250,80	50.532,28	35.197,89	0,04%	113.191,29	38.395,30	212.163,14
DEBI COELBA IPCA - CEEBC3	2.148.240,33	50.310,87	35.030,91	0,04%	112.813,52	38.216,42	211.630,69
DEBI COMGAS IPCA - GASP19	3.294.276,52	73.075,83	51.351,84	0,05%	166.258,93	55.446,80	316.756,02
DEBI CORSAN IPCA - RSAN44	5.674.203,47	96.111,59	73.795,94	0,08%	215.598,35	73.123,80	425.576,88
DEBI CTEEP IPCA - CTEE29	885.407,19	24.516,23	14.757,13	0,02%	52.403,63	16.732,38	93.088,95
DEBI ECHOENER IPCA - ECHP11	1.258.867,76	41.965,52	29.008,06	0,03%	81.228,69	32.676,73	131.765,92
DEBI ECHOENER IPCA - ECHP22	1.715.060,16	24.790,96	18.680,85	0,02%	57.003,34	19.428,47	113.664,44
DEBI EDPM IPCA - MGSP12	4.576.972,84	111.745,54	70.562,63	0,07%	249.050,47	78.732,18	465.093,19
DEBI ELEKTRO IPCA - EKTRC0	2.142.217,13	50.089,20	34.863,59	0,04%	112.434,97	38.037,18	211.097,13
DEBI ELETROB IPCA - ELET42	11.140.299,11	208.647,67	159.440,51	0,17%	463.770,46	158.700,92	912.110,56
DEBI ENERGISA IPCA - ENGA5	3.049.876,29	71.997,65	50.219,55	0,05%	160.600,08	54.763,07	300.033,74
DEBI ENERGMIR IPCA - ENMI21	933.815,86	12.466,46	9.228,81	0,01%	25.103,50	8.951,53	50.955,68
DEBI ENSINOP IPCA - CSNP12	1.758.880,96	34.440,15	25.946,39	0,03%	76.243,18	27.198,72	142.530,51
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	23.008.376,78	503.762,32	379.637,48	0,40%	1.095.962,31	390.230,34	2.070.500,84
DEBI HAZTEC IPCA - HZTC14	2.228.691,60	54.019,63	37.018,64	0,04%	117.418,33	40.430,98	214.798,32
DEBI HIDRO BR IPCA - HBSA21	4.198.181,51	100.004,88	69.754,31	0,07%	223.048,60	75.976,95	416.959,18



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.801.690.379,85	VAR / PL:	2,495%
VAR:	94.851.707,64	ETL / PL:	3,1288%
ETL:	118.947.908,83	VAR / CDI:	7179,98%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 152.906.812,50	BAIXA 1:	279.337.424,43	Cenário 1:	336.849.377,78
				Cenário 2:	- 74.108.977,90
				Cenário 3:	-519.785.163,10

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DEBI HOLDARAG IPCA - HARG11	7.383.917,62	203.997,07	131.796,31	0,14%	431.568,30	- 146.736,87	- 772.027,50
DEBI IGUA SAN IPCA - IGSN15	2.096.216,60	46.987,91	33.083,96	0,03%	105.191,13	- 35.834,94	- 196.437,03
DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21	1.524.566,68	19.811,42	14.454,62	0,02%	39.560,69	- 14.112,35	- 80.467,44
DEBI LAME IPCA - LAMEA6	7.027.440,92	171.046,68	119.913,45	0,13%	372.258,49	- 130.699,99	- 682.970,03
DEBI METRORIO IPCA - MTRJ19	10.040.262,77	191.152,77	148.536,90	0,16%	434.178,80	- 153.127,05	- 828.982,64
DEBI MG050 IPCA - CRMG15	4.191.432,09	72.171,57	55.528,28	0,06%	165.224,66	- 57.201,05	- 320.612,15
DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16	5.963.635,46	105.585,06	78.928,84	0,08%	239.572,82	- 80.313,03	- 478.920,77
DEBI NORTE EN IPCA - NTEN11	7.236.080,88	129.907,43	101.277,47	0,11%	283.801,52	- 100.850,69	- 547.038,08
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS11	1.196.779,34	16.211,05	12.585,70	0,01%	34.400,97	- 12.161,48	- 68.895,55
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS21	3.513.151,13	106.189,90	66.890,06	0,07%	219.574,30	- 76.078,45	- 384.907,31
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS22	2.462.911,22	59.864,14	40.514,90	0,04%	133.302,51	- 44.831,14	- 248.188,91
DEBI PARANAGU IPCA - PASN12	1.902.929,41	26.756,36	21.029,63	0,02%	60.895,85	- 21.330,32	- 120.342,45
DEBI QUATA IPCA - QUAT12	6.550.966,68	95.628,13	73.279,17	0,08%	185.376,00	- 66.726,55	- 375.025,10
DEBI RT BANDE IPCA - CBAN32	280.793,59	7.018,88	4.668,70	0,00%	15.620,49	- 5.160,58	- 29.285,45
DEBI RT BANDE IPCA - CBAN72	4.702.289,75	117.541,15	78.184,03	0,08%	261.587,48	- 86.421,28	- 490.426,68
DEBI TAUBATE IPCA - LTTE15	9.468.102,17	195.843,19	131.747,31	0,14%	442.291,45	- 144.688,37	- 824.498,05
DEBI TESC IPCA - CJEN13	9.833.007,40	258.112,56	175.719,45	0,19%	545.425,54	- 193.189,50	- 974.105,30
DEBI TUCANOHO IPCA - TNHL11	5.179.578,85	164.075,01	103.287,67	0,11%	340.859,44	- 114.695,14	- 602.598,04
DEBI UTE GNA IPCA - UNEG11	4.226.970,33	139.757,13	83.018,91	0,09%	288.402,20	- 94.516,10	- 507.196,62
DEBI VENSJOR IPCA - VSJH11	1.198.864,77	17.389,75	13.961,78	0,01%	37.597,87	- 13.729,46	- 73.358,79
DEBI VIARONDO IPCA - VRDN12	7.254.856,13	169.920,26	116.004,86	0,12%	378.020,87	- 126.526,74	- 707.828,20
ECCR32	3.325.273,82	30.837,49	11.097,56	0,01%	24.698,26	- 8.953,89	- 53.756,06
LF ipca	1.363.630,67	7.413,97	1.255,43	0,00%	11.020,82	- 3.992,64	- 23.948,41
LFS ITAU IPCA - LFS0120016V	5.200.742,03	35.658,65	9.048,10	0,01%	30.066,38	- 10.912,63	- 65.617,59
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GU	814.755,14	8.281,35	3.147,32	0,00%	6.550,89	- 2.373,90	- 14.244,04
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GZ	4.073.775,68	41.406,75	15.736,61	0,02%	32.754,46	- 11.869,51	- 71.220,21
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H2	9.777.061,64	99.376,21	37.767,87	0,04%	78.610,71	- 28.486,82	- 170.928,51
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H4	7.332.796,23	74.532,16	28.325,90	0,03%	58.958,03	- 21.365,11	- 128.196,38
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H6	5.703.285,95	57.969,46	22.031,26	0,02%	45.856,25	- 16.617,31	- 99.708,30
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001IP	8.175.791,79	85.700,90	33.082,58	0,03%	67.348,43	- 24.401,95	- 146.388,77
LFSN BRADESCO IPCA - LFSN16000GM	12.100.388,87	185.992,57	130.124,63	0,14%	325.490,74	- 116.586,95	- 688.736,18
LFSN BRADESCO IPCA M D - LFSN1800DC5	3.914.445,70	65.310,05	49.587,03	0,05%	121.304,67	- 43.336,47	- 255.119,76
NTNB	1.771.224.150,53	65.959.885,85	47.008.006,19	49,56%	198.373.897,19	- 63.633.665,30	-328.891.080,25
IDIJQF5	- 0,00	0,02	0,00	0,00%	- 1,42	0,00	0,00
IDIJQF6	0,01	0,09	0,00	0,00%	5,68	0,01	0,01
IDIJQFM	94.139,17	202.212,74	8.007,46	0,01%	351.169,24	- 91.556,83	- 96.166,17
IDIJQFN	- 152.885,52	284.445,18	- 11.267,89	-0,01%	- 424.950,77	144.825,95	155.090,33
AB AMERICAN GROWTH	8.468.516,71	1.755.850,38	353.558,60	-0,37%	- 1.659.062,22	- 76.216,65	2.920.554,76
BR ELETRO FIDC S1	12.506,18	77.332,36	12.759,63	0,01%	- 10.688,05	-	159.364,06
FARM SYN AGRO FIDC	3.261.845,96	19.170,85	4.053,45	0,00%	5.307,54	-	- 7.198,59
FIDC CELG DIST SN B	3.134.136,48	81.188,30	22.038,88	-0,02%	- 61.328,23	- 241,46	85.305,32
FIDC CREDZ MZ4	840.523,91	9.486,16	3.192,82	0,00%	4.994,38	-	6.739,61
FIDC VERDECARD SN4	7.038.891,12	609,55	99,63	0,00%	- 8.835,88	-	12.024,86
FII HSI LOGISTICA	1.171.194,75	161.321,45	17.299,15	0,02%	- 111.021,77	-	169.731,02
FII VIA PQ SHOPPING	1.114.162,50	637.067,24	90.593,87	0,10%	- 215.097,34	- 931,35	377.051,55



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.801.690.379,85	VAR / PL:	2,495%
VAR:	94.851.707,64	ETL / PL:	3,1288%
ETL:	118.947.908,83	VAR / CDI:	7179,98%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 152.906.812,50	BAIXA 1:	279.337.424,43	Cenário 1:	336.849.377,78
				Cenário 2:	- 74.108.977,90
				Cenário 3:	-519.785.163,10

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
FUNDSMITH EQ FUND	9.648.970,39	1.527.058,77	- 339.647,00	-0,36%	- 1.739.554,44	- 86.840,73	2.992.675,74
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.472.638,81	-	-	0,00%	-	-	-
LOOMIS US GROWTH	7.738.188,22	576.243,37	- 180.280,76	-0,19%	- 433.081,98	- 69.643,69	629.954,74
MFS MERIDIAN EUROPEA	6.545.745,44	675.557,89	- 260.243,83	-0,27%	- 893.328,32	- 58.911,71	1.444.402,51
PICTET GL FIC FIM IE	3.780.388,53	-	-	0,00%	-	-	-
RB CAP CREDIT AL SN4	794.635,45	4.596,47	- 124,65	0,00%	449,22	-	610,03
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	2.359.356,37	36.494,34	11.520,99	0,01%	15.382,09	-	20.743,13
WELLINGTON GLO QUAL	10.327.016,77	692.523,49	- 221.616,84	-0,23%	- 569.159,00	- 92.943,15	827.005,71
Total	3.790.581.511,53	226.261.713,57	94.851.707,64	100,00%	336.849.377,78	- 74.108.977,90	-519.785.163,10



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV RENDA FIXA CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	2.072.645.930,27	VAR / PL:	3,207%
VAR:	66.462.739,38	ETL / PL:	4,0213%
ETL:	83.346.985,10	VAR / CDI:	9228,00%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 135.768.297,02	BAIXA 1:	256.581.170,59	Cenário 1:	206.416.017,43
				Cenário 2:	- 63.963.283,20
				Cenário 3:	-342.126.786,64

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	6.000,00	9,33	5,31	0,00%	17,08	0,07	23,13
CONTAS A PAGAR / RECEBER	- 106.394,99	165,43	94,21	0,00%	302,84	1,18	410,16
COMPROMISSADA	139.389.359,12	211.065,45	118.647,59	0,18%	404.412,33	2.429,03	549.132,61
CMTR33	5.465.503,88	24.807,72	8.016,01	0,01%	16.961,20	452,32	24.180,16
CRI RB CAPIT IPCA M D - 17H0164854	7.541.861,99	84.794,04	49.826,87	0,07%	197.642,38	62.561,59	386.400,62
DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23	12.056.913,75	142.161,23	65.637,04	0,10%	308.333,43	98.470,00	614.210,03
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.683.874,31	53.849,41	8.675,48	0,01%	103.476,00	32.154,04	207.384,41
DE252 CEMIG - IPCA CMDT33	2.593.164,78	22.284,72	6.149,61	0,01%	42.347,82	12.539,48	84.591,68
DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17	36.894.599,74	783.021,96	375.901,84	0,57%	1.574.625,26	8.571,92	3.060.989,46
DE252 CSMG IPCA - CSMGC3	12.062.582,48	133.246,46	30.894,59	0,05%	263.250,25	81.984,44	525.602,75
DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24	14.225.538,94	87.504,21	2.273,31	0,00%	173.342,16	47.861,99	341.992,24
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	10.529.843,68	121.936,06	53.213,82	0,08%	260.496,12	82.998,70	518.027,06
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36	3.122.582,87	35.899,61	5.783,66	0,01%	68.984,00	21.436,03	138.256,27
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	983.557,61	12.181,69	443,61	0,00%	12.763,00	3.594,28	25.380,86
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	468.384,86	2.752,72	525,66	0,00%	1.840,04	179,98	2.929,00
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	616.627,91	3.657,10	123,65	0,00%	4.463,07	977,36	8.305,95
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	1.016.017,78	8.482,06	187,73	0,00%	10.431,94	2.722,23	20.327,93
DE252 IMED - IPCA SULM23	1.046.547,38	6.099,78	407,32	0,00%	4.987,09	720,88	8.468,09
DE252 PETR IPCA - PETR45	14.088.397,52	162.742,23	13.569,70	0,02%	287.214,85	88.381,71	578.199,67
DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34	8.477.698,60	43.338,67	2.138,74	0,00%	73.432,61	19.231,93	132.662,79
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	4.925.428,41	61.003,08	2.221,51	0,00%	63.914,17	17.999,33	127.101,46
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	14.245.324,04	156.877,88	52.133,54	0,08%	310.890,60	96.659,28	622.286,32
DE252 TRANS AL - IPCA TAE33	11.333.408,17	118.083,44	13.217,45	0,02%	211.913,47	64.532,55	428.119,22
DEBI ELETRO IPCA - ELET42	11.142.345,09	209.466,12	189.025,90	0,28%	496.144,24	159.075,74	956.789,51
DEBI ENERGMIR IPCA - ENMI21	933.191,25	11.996,91	7.387,13	0,01%	27.870,33	8.981,25	54.795,43
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	23.026.740,77	505.646,40	459.630,78	0,69%	1.162.543,07	390.926,26	2.162.609,06
DEBI IGUA SAN IPCA - IGSN15	2.095.298,42	47.181,74	43.294,44	0,07%	111.421,13	35.886,29	205.202,90
DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21	1.523.533,61	19.000,43	11.192,82	0,02%	44.077,00	14.159,99	86.732,88
DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16	5.965.676,23	106.474,19	96.633,00	0,15%	256.883,69	80.515,15	502.742,86
ECCR32	3.325.494,15	27.762,36	614,46	0,00%	34.144,45	8.910,04	66.534,67
LFS ITAU IPCA - LFS0120016V	5.195.331,71	31.294,12	11,79	0,00%	44.766,35	10.823,45	85.458,60
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GU	814.813,28	7.526,02	200,83	0,00%	8.868,69	2.364,34	17.382,02
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GZ	4.074.066,40	37.630,09	1.004,15	0,00%	44.343,47	11.821,69	86.910,11
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H2	9.777.759,36	90.312,22	2.409,97	0,00%	106.424,32	28.372,06	208.584,27
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H4	7.333.319,52	67.734,16	1.807,48	0,00%	79.818,24	21.279,04	156.438,20
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H6	5.703.692,96	52.682,13	1.405,81	0,00%	62.080,85	16.550,37	121.674,16
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001IP	8.176.392,19	78.129,55	2.191,56	0,00%	90.618,60	24.310,20	177.902,24
LFSN BRADESCO IPCA - LFSN16000GM	12.085.924,30	176.774,71	88.237,31	0,13%	362.003,39	117.187,71	739.500,50
LFSN BRADESCO IPCA M D - LFSN1800DC5	3.910.170,51	63.088,68	41.245,62	0,06%	133.033,19	43.500,09	271.358,41
NTNB	1.658.021.071,25	64.776.806,16	64.742.210,78	97,41%	198.955.540,41	62.242.159,33	-327.822.009,26
Total	2.068.771.643,81	68.585.470,23	66.462.739,38	100,00%	206.416.017,43	- 63.963.283,20	-342.126.786,64



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	743.465.789,39	VAR / PL:	9,293%
VAR:	69.092.156,62	ETL / PL:	11,6541%
ETL:	86.644.381,54	VAR / CDI:	26743,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	1.553,80	BAIXA 1:	1.674,96	Cenário 1:	126.182.880,36
					Cenário 2:	407.367,50
					Cenário 3:	-127.478.679,80

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	21.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	1.765.296,95	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	20.186.431,24	1.834.614,08	936.214,47	-1,36%	190.145,13	744,81	261.289,24
ALPA4	252.647,04	34.544,96	15.497,10	-0,02%	27.067,17	111,59	42.060,25
ALSO3	2.699.997,25	327.788,31	221.398,63	0,32%	500.534,36	1.790,77	557.123,03
AMER3	6.626.026,55	1.042.054,82	647.577,04	0,94%	769.886,14	-	919.376,59
ASAI3	5.512.698,89	778.706,81	393.590,38	0,57%	495.903,63	-	608.941,85
AZUL4	493.152,43	118.750,43	102.952,95	0,15%	103.356,74	365,97	112.360,90
B3SA3	23.597.791,31	5.914.244,16	5.364.831,08	7,76%	11.063.706,62	35.398,22	9.602.952,84
Banco BTG Pactual SA UNT	21.075.273,41	3.944.100,19	3.269.225,05	4,73%	6.211.580,29	21.234,34	6.238.768,50
BBAS3	15.997.945,79	2.289.865,89	1.469.909,46	2,13%	4.742.221,95	16.200,32	4.755.753,05
BBDC3	1.341.304,80	179.841,94	145.197,28	0,21%	279.738,76	990,93	304.410,08
BBDC4	33.917.622,12	5.005.720,04	4.137.897,18	5,99%	7.733.362,84	27.170,28	8.260.273,27
BBRK3	26.880,00	8.125,45	6.800,75	0,01%	6.973,44	24,18	7.232,67
BBSE3	3.936.252,91	422.544,81	122.350,69	0,18%	590.006,12	2.143,92	680.457,81
BEEF3	125.641,80	23.732,63	7.689,04	-0,01%	29.508,83	131,06	55.126,46
BID11	3.132.304,80	584.535,27	263.866,43	0,38%	796.691,53	2.768,59	830.203,46
BID3	351,56	57,94	20,73	0,00%	71,40	0,25	78,11
BID4	7.586,32	1.357,99	623,65	0,00%	1.839,81	6,42	1.938,46
BMGB4	197.192,02	33.334,40	16.845,28	0,02%	5.873,55	23,25	8.271,63
BPAN4	2.398.402,69	396.520,36	331.093,57	0,48%	500.984,29	1.774,42	544.997,12
BRAP4	349.460,75	80.918,92	15.561,20	0,02%	50.408,44	212,16	82.385,94
BRFS3	937.480,39	184.573,43	52.634,30	0,08%	116.117,78	483,17	184.538,16
BRKM5	672.989,79	171.731,67	67.111,34	-0,10%	112.294,21	478,80	189.479,84
BRML3	9.662.819,41	1.760.471,39	1.527.520,84	2,21%	3.376.049,75	11.294,99	3.232.062,30
BRPR3	388.064,04	37.684,95	19.524,79	0,03%	51.509,08	188,61	60.459,96
CASH3	2.183.079,09	539.157,68	400.656,75	0,58%	350.884,73	-	400.262,50
CCRO3	749.671,00	95.897,02	50.958,87	0,07%	176.072,27	616,84	186.852,21
CESP6	11.140.515,61	1.711.879,42	904.097,91	1,31%	2.460.432,74	8.670,48	2.646.015,78
CIEL3	136.086,40	12.261,70	8.043,47	0,01%	11.774,46	44,03	14.512,03
CLSA3	4.047.472,00	-	-	0,00%	-	-	-
CMIG4	756.261,74	46.525,19	19.664,21	0,03%	49.148,03	185,67	62.015,78
CMIN3	404.016,36	42.458,31	22.302,01	0,03%	14.355,98	-	18.722,06
COGN3	245.061,30	42.972,46	28.096,80	0,04%	72.251,27	246,98	72.561,25
CPFE3	7.614.347,21	645.979,04	356.191,31	0,52%	940.153,51	3.456,89	1.114.187,28
CPLE6	580.811,74	64.506,49	60.978,21	0,09%	89.332,18	324,05	102.618,61
CRFB3	2.122.774,63	234.185,12	179.588,90	0,26%	284.359,87	1.040,65	333.352,49
CSAN3	1.435.731,77	154.732,51	132.929,84	0,19%	247.633,04	890,94	279.175,70
CSED3	2.703.125,01	648.519,90	188.278,05	-0,27%	174.206,76	-	256.119,82
CSNA3	847.979,08	145.395,30	103.260,96	0,15%	59.817,69	225,38	75.019,14
CVCB3	167.258,82	35.691,37	27.708,33	0,04%	54.423,85	183,80	53.197,70



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	743.465.789,39	VAR / PL:	9,293%
VAR:	69.092.156,62	ETL / PL:	11,6541%
ETL:	86.644.381,54	VAR / CDI:	26743,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	1.553,80	BAIXA 1:	1.674,96	Cenário 1:	126.182.880,36
					Cenário 2:	407.367,50
					Cenário 3:	-127.478.679,80

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CYRE3	4.915.306,23	905.813,73	805.407,74	1,17%	1.259.324,34	4.372,95	- 1.310.038,58
DXCO3	228.286,50	34.606,85	1.476,94	0,00%	22.216,59	-	- 27.066,12
ECOR3	139.083,12	24.017,32	17.490,30	0,03%	49.559,86	165,36	- 47.164,79
EGIE3	5.564.422,60	267.199,31	135.657,51	0,20%	498.699,42	1.862,32	- 612.595,02
ELET3	2.607.119,39	316.154,31	269.792,92	0,39%	536.637,75	1.903,17	- 585.503,46
ELET6	7.678.179,02	902.198,65	804.694,04	1,16%	1.389.561,87	4.980,95	- 1.553.403,21
ENBR3	254.964,48	18.497,36	4.602,58	0,01%	34.436,61	125,96	- 40.323,62
ENEV3	5.044.199,05	534.876,89	29.094,34	-0,04%	345.832,66	1.304,24	- 434.663,75
ENG11	562.517,55	53.296,62	12.742,29	0,02%	64.751,14	238,99	- 77.411,90
ENJU3	103.620,01	24.535,21	19.515,11	0,03%	35.825,23	-	- 34.405,06
EQTL3	14.051.933,77	757.568,27	467.052,44	0,68%	994.892,31	3.748,09	- 1.247.368,78
ESPA3	42.174,00	6.335,34	273,58	0,00%	4.287,11	-	- 6.613,59
EUCATEX PN	128.843,01	12.961,64	2.215,05	0,00%	4.676,55	17,91	- 6.093,54
EZTC3	112.138,10	18.548,36	14.439,91	0,02%	21.136,03	75,52	- 23.454,01
FLRY3	316.847,40	53.247,37	50.547,84	0,07%	89.286,86	306,82	- 90.729,80
GGBR4	8.791.760,64	890.295,07	110.049,70	0,16%	913.134,18	3.387,65	- 1.104.727,74
GGPS3	4.324.145,40	687.349,63	242.246,52	0,35%	615.627,10	-	- 715.477,79
GMAT3	6.117.423,65	706.958,10	484.549,19	0,70%	571.334,88	2.129,85	- 698.979,65
GNDI3	16.747.308,07	3.450.396,17	2.901.852,82	4,20%	5.843.844,95	19.554,66	- 5.596.736,34
GOAU4	1.400.803,13	119.354,40	30.497,43	0,04%	137.680,45	512,09	- 167.560,59
GOLL4	158.464,56	26.533,64	12.606,44	0,02%	19.603,87	72,07	- 23.226,97
HAPV3	15.297.495,87	3.674.558,14	3.022.452,91	4,37%	6.534.814,80	21.228,66	- 5.863.438,50
HBSA3	404.800,75	78.970,06	501,09	0,00%	53.959,48	225,71	- 86.865,68
HYPE3	5.219.636,22	524.270,11	472.250,97	0,68%	796.999,54	2.892,49	- 916.571,79
IGTH1	1.024.880,08	195.489,77	112.393,93	0,16%	-	-	-
INTB3	5.929.190,30	907.342,59	658.666,22	0,95%	1.351.948,38	-	- 1.444.047,36
IRBR3	212.180,49	32.071,52	17.024,78	-0,02%	19.433,39	79,45	- 29.585,63
ITSA4	17.594.900,09	2.616.095,17	2.315.506,87	3,35%	3.210.600,69	11.501,09	- 3.583.849,74
ITUB4	37.301.363,46	7.555.201,87	6.252.082,12	9,05%	7.818.208,79	27.682,67	- 8.499.211,49
JBSS3	16.385.240,42	1.527.823,05	879.779,90	-1,27%	1.785.363,01	7.368,09	- 2.781.071,77
JHSF3	99.459,24	19.093,25	13.409,82	0,02%	28.733,75	98,46	- 29.011,28
KLBN11	1.046.626,96	113.479,25	60.837,39	-0,09%	73.453,16	296,87	- 108.780,51
LCAM3	2.103.934,68	335.878,19	157.828,29	0,23%	438.257,65	1.552,63	- 477.026,03
LREN3	12.231.919,04	2.940.751,82	2.135.163,02	3,09%	6.024.968,76	19.113,67	- 5.133.879,90
LWSA3	2.488.748,43	708.646,11	223.289,63	-0,32%	408.210,12	1.737,68	- 686.008,74
MATD3	2.906.042,67	1.139.365,40	353.911,93	-0,51%	316.438,79	-	- 380.799,91
MDNE3	106.602,01	28.014,62	24.675,87	0,04%	38.461,14	128,11	- 36.463,59
MEGA3	2.510.683,05	16.825.458,58	3.263.825,61	4,72%	-	-	-
MGLU3	6.657.791,00	2.543.791,30	1.668.874,47	2,42%	684.513,05	2.540,71	- 829.060,79
MOVI3	7.531.360,00	1.598.844,16	326.121,49	0,47%	2.079.017,19	7.160,96	- 2.123.682,03
MRFG3	405.179,52	42.462,75	8.109,90	0,01%	6.515,86	25,61	- 9.025,41
MRVE3	441.363,35	68.189,11	57.487,50	0,08%	123.908,36	425,98	- 126.031,64



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	743.465.789,39	VAR / PL:	9,293%
VAR:	69.092.156,62	ETL / PL:	11,6541%
ETL:	86.644.381,54	VAR / CDI:	26743,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	1.553,80	BAIXA 1:	1.674,96	Cenário 1:	126.182.880,36
					Cenário 2:	407.367,50
					Cenário 3:	-127.478.679,80

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
MULT3	8.633.927,04	1.491.208,59	1.049.286,93	1,52%	3.337.872,86	11.009,16	- 3.096.459,25
NINJ3	63.373,01	23.225,09	8.516,79	0,01%	- 9.780,74	-	16.212,71
NTCO3	12.690.276,51	2.279.460,73	1.204.049,51	1,74%	- 95.142,93	- 372,32	130.442,57
PACUCAR_CBD ON ED	184.343,98	21.910,47	9.131,03	0,01%	20.000,14	74,04	- 24.078,10
PARD3	854.511,38	164.539,40	147.633,45	0,21%	316.920,23	1.051,56	- 297.902,74
PETR3	29.323.654,36	3.847.759,00	2.927.792,29	4,24%	6.833.641,83	23.958,61	- 7.264.524,19
PETR4	49.174.523,61	6.655.700,70	5.082.758,87	7,36%	12.689.066,23	44.028,94	- 13.177.649,16
PETZ3	277.230,46	60.319,49	45.549,75	0,07%	121.799,24	393,90	- 108.220,74
POS3	37.908,00	8.547,29	2.218,10	0,00%	- 1.988,19	- 7,96	2.879,29
POWE3	38.255,00	5.473,28	2.878,87	0,00%	2.497,56	-	3.150,42
PRI03	17.131.695,53	4.407.775,30	3.341.264,83	4,84%	5.817.858,55	19.538,57	- 5.616.915,47
QUAL3	395.728,81	58.233,24	53.459,39	0,08%	77.459,70	275,90	- 85.346,13
RADL3	7.380.072,96	1.048.612,12	418.464,06	-0,61%	- 369.950,92	- 1.479,57	534.213,52
RAIL3	11.843.412,27	1.420.776,77	446.663,01	-0,65%	- 70.778,30	- 276,76	96.863,06
RAPT4	3.156.888,00	387.321,71	351.102,94	0,51%	602.965,92	2.152,02	- 667.441,98
RDOR3	1.288.559,68	161.568,45	140.076,97	0,20%	200.719,68	-	230.114,56
RECV3	1.803.360,17	478.400,17	335.357,28	0,49%	140.606,76	-	174.913,01
RENT3	8.139.657,58	1.301.296,96	608.944,31	0,88%	1.699.820,42	6.020,67	- 1.849.244,42
RRRP3	393.642,56	102.859,85	73.999,95	0,11%	39.108,45	145,39	- 47.541,98
SANB11	616.871,29	78.987,95	56.594,09	0,08%	101.451,36	366,29	- 115.294,58
SBSP3	658.059,04	109.155,94	36.138,29	-0,05%	- 45.288,09	- 182,91	66.953,41
SEER3	885.116,65	141.835,82	129.592,40	0,19%	264.897,60	903,91	- 264.976,26
SOMA3	3.640.007,80	780.170,37	596.278,94	0,86%	1.471.588,83	4.821,45	- 1.345.302,71
STBP3	6.892.750,00	1.379.529,94	852.716,71	1,23%	1.239.109,54	4.443,97	- 1.386.864,22
SULA11	2.211.781,37	243.063,70	63.801,32	-0,09%	56.821,77	218,74	- 74.940,84
SUZB3	20.427.966,78	1.774.475,52	530.960,35	-0,77%	- 588.537,40	- 2.328,07	827.844,10
TAE11	430.023,22	20.123,42	14.251,31	0,02%	21.918,84	83,36	- 28.091,65
TEND3	1.964.427,18	267.731,01	28.168,92	0,04%	325.448,84	1.174,39	- 369.408,28
TIMS3	2.881.726,47	274.460,03	67.695,81	-0,10%	171.844,97	650,82	- 218.125,24
TOTS3	6.162.229,53	806.003,62	264.828,27	0,38%	1.088.190,90	3.908,11	- 1.221.794,41
UGPA3	3.398.118,12	513.145,65	157.388,77	0,23%	563.517,59	2.033,33	- 639.530,43
USIM5	7.800.067,51	1.277.385,27	912.277,49	1,32%	956.494,15	3.518,32	- 1.134.552,10
VALE3	74.023.060,68	9.926.481,21	5.972.029,08	8,64%	3.024.589,15	11.558,19	- 3.920.709,84
VBBR3	12.215.364,41	1.479.088,42	1.128.324,54	1,63%	2.626.768,76	-	2.840.665,91
VIIA3	389.593,52	55.630,42	40.395,44	0,06%	49.698,62	-	58.648,07
VITT3	531.031,17	156.453,91	123.175,09	-0,18%	- 123.217,72	-	229.171,32
VIVT3	1.115.713,44	88.162,22	43.797,34	-0,06%	33.636,09	129,21	- 44.135,89
WEGE3	11.780.015,04	1.330.217,88	373.187,84	0,54%	1.099.241,69	4.097,95	- 1.344.945,03
WEST3	98.099,01	49.342,19	39.662,82	0,06%	33.228,40	-	32.104,97
YDUQ3	1.769.176,00	310.670,27	189.425,99	0,27%	583.789,21	1.967,98	- 568.353,19
INDG22	-	193.776,09	189.099,50	0,27%	-	-	-
COMPROMISSADA	25.088.036,74	1.174,53	710,92	0,00%	1.377,49	- 715,20	- 2.120,51



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	743.465.789,39	VAR / PL:	9,293%
VAR:	69.092.156,62	ETL / PL:	11,6541%
ETL:	86.644.381,54	VAR / CDI:	26743,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	1.553,80	BAIXA 1:	1.674,96	Cenário 1:	126.182.880,36
					Cenário 2:	407.367,50
					Cenário 3:	-127.478.679,80

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
EMP AÇÃO PROVISÃO	38.311,34	174,78 -	11,08	0,00%	467,36 -	198,20 -	528,91
LFT	305.473,34	84,33	69,62	0,00%	0,00 -	0,00 -	0,00
Total	745.779.783,89	128.064.836,50	69.092.156,62	100,00%	126.182.880,36	407.367,50	-127.478.679,80



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FI RF EMB II CNPJ - 11005764000196

Dados Gerais

PL:	1.886.513.638,78	VAR / PL:	3,161%
VAR:	59.623.285,89	ETL / PL:	3,9634%
ETL:	74.770.031,56	VAR / CDI:	9095,16%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 132.897.958,10	BAIXA 1:	252.940.534,53	Cenário 1:	206.902.039,60
				Cenário 2:	- 63.015.254,01
				Cenário 3:	-340.793.620,80

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	5.000,00	27,07 -	9,69	0,00%	24,00	0,09 -	32,43
CONTAS A PAGAR / RECEBER	- 72.433,61	392,10	140,32	0,00%	- 347,67 -	1,35	469,79
COMPROMISSADA	132.673.784,84	722.980,35 -	260.968,90	-0,44%	644.103,24 -	1.305,40 -	871.713,21
DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17	30.569.811,21	628.688,47	223.545,85	0,37%	1.364.406,86 -	6.870,52 -	2.616.671,19
DE252 CSMG IPCA - CSMGC3	12.062.582,48	176.833,79	9.175,96	0,02%	286.814,20 -	81.892,92 -	557.336,88
DE252 PETR IPCA - PETR45	14.088.397,52	216.205,28 -	12.216,22	-0,02%	314.736,19 -	88.274,82 -	615.263,30
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	4.813.486,86	79.050,07 -	10.407,74	-0,02%	71.864,60 -	17.553,74 -	136.876,07
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	8.064.788,20	114.511,12	14.323,16	0,02%	191.760,67 -	54.661,09 -	373.515,35
DEBI ELETROB IPCA - ELET42	11.142.345,09	196.607,06	162.034,27	0,27%	517.910,53 -	158.991,21 -	986.102,69
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	9.948.546,87	205.708,85	175.557,38	0,29%	521.703,07 -	168.821,55 -	960.513,09
DEBI IGUA SAN IPCA - IGSN15	2.095.298,42	43.294,15	37.774,70	0,06%	115.514,25 -	35.870,39 -	210.715,19
DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16	5.965.676,23	98.521,12	81.412,41	0,14%	268.537,49 -	80.469,88 -	518.437,30
LFS ITAU IPCA - LFS0120016V	5.195.331,71	51.570,01 -	12.717,99	-0,02%	54.915,30 -	10.784,04 -	99.126,43
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GU	814.813,28	10.847,26 -	1.866,86	0,00%	10.460,41 -	2.358,16 -	19.525,63
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GZ	4.074.066,40	54.236,28 -	9.334,32	-0,02%	52.302,05 -	11.790,78 -	97.628,13
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H2	9.777.759,36	130.167,08 -	22.402,37	-0,04%	125.524,92 -	28.297,88 -	234.307,51
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H4	7.333.319,52	97.625,31 -	16.801,78	-0,03%	94.143,69 -	21.223,41 -	175.730,63
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H6	5.703.692,96	75.930,80 -	13.068,05	-0,02%	73.222,87 -	16.507,09 -	136.679,38
NTNB	1.658.021.071,25	59.313.947,47	59.279.115,77	99,42%	202.194.442,94 -	62.229.579,87	-332.183.916,18
Total	1.922.277.338,58	62.217.143,65	59.623.285,89	100,00%	206.902.039,60	- 63.015.254,01	-340.793.620,80



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FI RF EMB V CREDITO PRIVADO CNPJ - 20726178000121

Dados Gerais

PL:	186.132.340,87	VAR / PL:	0,741%
VAR:	1.378.707,49	ETL / PL:	0,9289%
ETL:	1.728.955,41	VAR / CDI:	2131,60%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 3.692.165,01	BAIXA 1:	3.025.387,75	Cenário 1:	2.852.115,79
				Cenário 2:	- 935.068,18
				Cenário 3:	-5.825.534,91

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	- 33.961,38	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	6.715.574,28	314,40	25,81	0,00%	368,73	- 191,45	- 567,62
CMTR33	5.465.503,88	22.445,08	3.448,31	0,25%	1.404,15	- 512,89	- 3.110,45
CRI RB CAPIT IPCA M D - 17H0164854	7.541.861,98	86.485,95	85.535,70	6,20%	176.175,16	- 62.645,16	- 357.326,47
DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23	12.056.913,74	146.885,20	144.758,45	10,50%	274.014,53	- 98.603,61	- 567.730,19
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.683.874,30	57.232,77	52.856,48	3,83%	90.143,78	- 32.205,94	- 189.327,90
DE252 CEMIG - IPCA CMDT33	2.593.164,78	24.018,68	22.633,15	1,64%	34.966,62	- 12.568,22	- 74.594,93
DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17	6.324.788,53	132.218,54	63.058,92	4,57%	251.932,83	- 1.539,56	- 500.358,76
DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24	14.225.538,93	97.853,00	70.021,55	5,08%	132.850,47	- 48.019,63	- 287.152,27
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	10.529.843,68	126.405,22	124.477,85	9,03%	230.523,89	- 83.115,38	- 477.434,13
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36	3.122.582,87	38.155,18	35.237,65	2,56%	60.095,86	- 21.470,63	- 126.218,60
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	983.557,61	13.074,50	8.859,53	0,64%	9.963,40	- 3.605,18	- 21.589,21
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	468.384,86	2.776,41	599,24	0,04%	506,82	- 185,17	- 1.123,36
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	616.627,91	3.440,74	518,40	0,04%	2.707,90	- 984,19	- 5.928,83
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	1.016.017,78	9.342,81	6.621,56	0,48%	7.539,94	- 2.733,49	- 16.411,14
DE252 IMED - IPCA SULM23	1.046.547,38	5.727,24	545,82	0,04%	2.008,19	- 732,48	- 4.433,61
DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34	8.477.698,60	49.761,58	32.035,70	2,32%	49.301,62	- 19.325,87	- 99.980,96
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	111.941,55	1.488,05	1.008,33	0,07%	1.133,96	- 410,32	- 2.457,13
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	6.180.535,84	71.606,54	69.415,58	5,03%	117.291,97	- 42.005,49	- 246.161,56
DE252 TRANS AL - IPCA TAAE33	11.333.408,17	127.222,05	115.649,63	8,39%	179.653,97	- 64.658,14	- 384.428,52
DEBI ENERGMIR IPCA - ENM21	933.191,25	12.152,62	11.855,68	0,86%	25.214,08	- 8.991,59	- 51.197,94
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	13.078.193,90	280.206,58	192.195,57	13,94%	623.048,36	- 222.174,15	-1.177.851,60
DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21	1.523.533,61	19.323,72	18.975,97	1,38%	39.740,40	- 14.176,87	- 80.859,60
ECCR32	3.325.494,15	30.579,63	21.672,80	1,57%	24.678,74	- 8.946,89	- 53.714,77
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001IP	8.176.392,19	85.290,27	59.654,83	4,33%	67.345,25	- 24.400,81	- 146.381,95
LFSN BRADESCO IPCA - LFSN16000GM	12.085.924,29	180.794,81	176.723,64	12,82%	327.601,92	- 117.321,64	- 692.908,83
LFSN BRADESCO IPCA M D - LFSN1800DC5	3.910.170,51	63.333,51	60.321,35	4,38%	121.903,25	- 43.543,42	- 256.284,56
Total	146.494.305,20	1.688.135,08	1.378.707,49	100,00%	2.852.115,79	- 935.068,18	-5.825.534,91



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIM EMB | A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	226.298.770,14	VAR / PL:	0,321%
VAR:	725.712,99	ETL / PL:	0,4022%
ETL:	910.073,68	VAR / CDI:	922,86%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 2.100.108,22	BAIXA 1:	1.772.142,19	Cenário 1:	2.585.620,79
				Cenário 2:	- 718.601,32
				Cenário 3:	-3.767.679,76

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	13,99 -	8,71	0,00%	25,62	0,10 -	34,70
CONTAS A PAGAR / RECEBER	- 87.151,03	135,51	84,39	0,01%	- 248,07 -	0,97	335,97
DI1J22	-	3.801,59	2.790,08	0,38%	18.883,83 -	9.767,35 -	28.886,02
DI1N22	-	144.906,74	135.319,42	18,65%	355.266,53 -	182.967,32 -	539.563,68
DI1F23	-	595.999,00	577.262,82	79,54%	938.886,54 -	479.909,67 -	-1.408.171,30
DOLH22	-	349.587,08	170.678,87	23,52%	382.065,72	49.635,80 -	563.083,51
WDOH22	-	50.849,03 -	24.826,02	-3,42%	- 55.573,20 -	7.219,75	81.903,06
COMPROMISSADA	106.775.455,72	161.680,99 -	101.729,34	-14,02%	309.789,15 -	1.860,69 -	420.648,21
DE252 AERIS CDI - AERI11	1.239.983,41	1.965,43 -	193,85	-0,03%	5.373,65 -	916,67 -	7.486,99
DE252 AUTOBAN CDI - ANHB10	935.604,50	1.375,93 -	608,41	-0,08%	3.173,26 -	246,35 -	4.352,44
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.747.444,91	2.450,04 -	1.318,00	-0,18%	5.469,99 -	232,97 -	7.474,58
DE252 BCBF CDI - BCBF14	274.511,77	403,86 -	95,60	-0,01%	1.080,86 -	148,38 -	1.499,41
DE252 CONT GLO CDI - CGBP13	2.435.023,17	6.059,26	319,07	0,04%	13.677,23 -	3.303,84 -	18.943,36
DE252 ELETROB CDI - ELET13	2.111.824,57	3.845,00 -	281,26	-0,04%	9.577,02 -	1.764,86 -	13.323,11
DE252 ENER TR CDI - ETEN13	2.966.564,24	65.683,68	30.571,73	4,21%	112.332,35 -	50.188,22 -	153.632,57
DE252 EQUATENE CDI - EQTL13	1.480.660,57	2.078,59 -	926,95	-0,13%	4.996,62 -	380,24 -	6.865,96
DE252 GUARIROB CDI - GRRB14	1.060.876,58	1.607,87 -	608,51	-0,08%	3.778,42 -	369,08 -	5.193,96
DE252 INTERVIA CDI - IVIA35	1.326.680,42	1.885,71 -	783,23	-0,11%	4.590,64 -	397,49 -	6.316,14
DE252 MOV_PART CDI - MOVI33	1.464.602,27	2.149,64 -	1.334,85	-0,18%	4.168,87	16,23 -	5.646,11
DE252 OMEGA GE CDI - OMGE13	1.125.532,02	2.898,78	198,61	0,03%	6.470,36 -	1.599,90 -	8.963,92
DE252 PROLAGOS CDI - PRLG14	3.132.127,26	40.372,66 -	33.883,96	-4,67%	- 49.084,39	29.372,12	73.414,49
DE252 RT BANDE CDI - CBAN22	1.053.802,64	1.987,66 -	84,19	-0,01%	4.946,66 -	962,32 -	6.880,34
DE252 SUL AME CDI - SULM15	667.949,55	1.280,53 -	992,68	-0,14%	1.231,06	353,05 -	1.554,71
DE252 TELEF BR CDI - VIVT15	2.174.414,47	15.240,73	14.003,69	1,93%	25.548,41 -	10.144,46 -	38.714,80
DE252 VAMOS CDI - VAMO22	1.122.425,29	1.851,81 -	264,44	-0,04%	4.770,05 -	779,23 -	6.624,41
LF selic	3.065.367,70	4.499,14 -	2.793,80	-0,38%	8.725,32	33,97 -	11.817,14
LF252 B.ALFA CDI - LF0021006S0	1.029.570,22	1.511,13 -	938,36	-0,13%	2.930,59	11,41 -	3.969,04
LF252 BES INV CDI - LF00220018H	1.034.933,51	1.519,00 -	943,25	-0,13%	2.945,85	11,47 -	3.989,72
LF252 DAYCOVAL CDI - LF002100HDP	1.226.153,53	1.799,66 -	1.117,53	-0,15%	3.490,15	13,59 -	4.726,88
LF252 DAYCOVAL CDI - LF002100HDQ	2.233.732,12	3.278,52 -	2.035,84	-0,28%	6.358,13	24,75 -	8.611,15
LFT	86.384.755,00	120.600,66 -	76.697,89	-10,57%	245.887,10	957,27 -	333.017,52
LFV TOYOTA CDI - LF002100ISJ	2.290.026,31	3.361,14 -	2.087,15	-0,29%	6.518,37	25,38 -	8.828,17
NTNB	1.255.777,07	61.558,15	8.904,26	1,23%	190.346,94 -	59.135,34 -	305.469,10
IDIJQFM	6.169,11	48.812,04 -	19.894,88	-2,74%	- 3.460,36 -	6.169,00 -	5.150,50
IDIJQFN	- 19.407,93	147.280,42	60.028,75	8,27%	10.681,54	19.407,66	16.106,17
Total	231.524.408,97	1.854.330,97	725.712,99	100,00%	2.585.620,79 -	718.601,32 -	-3.767.679,76



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIM EMB II A CNPJ - 20725957000102

Dados Gerais

PL:	219.457.026,15	VAR / PL:	1,035%
VAR:	2.270.836,81	ETL / PL:	1,2976%
ETL:	2.847.721,95	VAR / CDI:	2977,77%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 4.971.321,67	BAIXA 1:	6.619.561,19	Cenário 1:	5.739.076,21
				Cenário 2:	-1.985.164,39
				Cenário 3:	-9.861.585,24

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	13,99	0,25	0,00%	25,62	0,10	34,70
CONTAS A PAGAR / RECEBER	- 35.445,09	55,11	0,97	0,00%	- 100,89	0,39	136,64
WSPH22	2.956.782,54	464.206,06	17.767,85	-0,78%	- 178.439,11	- 26.578,28	262.882,99
INDG22	-	728.967,21	310.433,72	13,67%	-	-	-
WING22	-	273.132,02	116.314,41	5,12%	-	-	-
DI1J22	-	856,70	465,31	0,02%	4.255,51	- 2.201,09	- 6.509,53
DI1N22	-	1.684,96	961,02	0,04%	4.131,01	- 2.127,53	- 6.274,00
DI1V22	-	7.646,54	4.871,86	0,21%	13.370,73	- 6.858,99	- 20.173,92
DI1F23	-	223.380,81	149.000,99	6,56%	351.895,27	- 179.870,45	- 527.783,50
DI1N23	-	31.186,90	25.292,94	1,11%	47.812,76	- 24.279,99	- 70.935,19
DI1F24	-	322.206,17	292.908,86	12,90%	471.881,02	- 238.272,50	- 693.516,66
DI1N24	-	26.969,15	24.820,27	1,09%	38.545,46	- 19.354,99	- 56.127,80
DI1F25	-	49.358,86	45.153,47	1,99%	69.638,11	- 34.762,55	- 100.419,17
DI1F27	-	77.555,29	66.427,17	2,93%	111.394,89	- 54.222,86	- 154.085,57
DI1F29	-	101.903,18	82.435,76	3,63%	152.570,00	- 72.344,57	- 202.157,27
DI1F31	-	31.569,47	24.362,34	1,07%	49.702,06	- 22.965,94	- 63.135,46
WDOH22	-	177.971,60	12.271,78	-0,54%	194.506,18	25.269,13	- 286.660,70
COMPROMISSADA	62.153.205,07	94.113,31	743,81	0,03%	180.325,98	- 1.083,10	- 244.856,22
LTN	5.475.605,60	87.716,03	74.189,06	3,27%	155.546,78	- 71.013,47	- 228.755,32
DE252 AEGEA SA CDI - AEGP13	1.042.829,15	1.492,22	64,23	0,00%	3.070,75	- 40,90	- 4.174,26
DE252 COPEL GT CDI - CPGT14	290.061,06	996,30	552,80	-0,02%	- 365,42	615,00	682,83
DE252 COPEL GT CDI - CPGT16	290.157,97	699,76	439,06	-0,02%	85,18	379,55	- 18,65
DE252 ECORODOV CDI - ERDV18	1.839.073,90	35.017,08	28.156,70	1,24%	55.042,33	- 23.832,90	- 74.170,46
DE252 ENERSUL CDI - ESUL18	1.015.429,71	1.839,77	269,21	-0,01%	2.047,58	447,78	- 2.622,27
DE252 TELEF BR CDI - VIVT15	2.938.397,93	20.595,58	16.025,82	0,71%	34.524,88	- 13.708,73	- 52.317,29
LF selic	3.801.619,12	6.594,93	3.142,59	-0,14%	5.880,73	2.613,98	- 7.016,36
LFT	38.523.215,20	48.706,59	5.262,09	-0,23%	109.653,16	426,89	- 148.508,91
NTNB	105.314.908,61	1.146.645,02	1.033.302,26	45,50%	3.866.700,53	-1.212.918,75	-7.168.017,81
IDJQFM	- 3.951,08	31.262,25	7.243,82	-0,32%	2.216,23	3.951,01	3.298,70
IDJQFN	12.430,04	94.327,50	21.856,77	0,96%	- 6.841,12	- 12.429,87	- 10.315,39
Total	225.623.319,74	4.088.670,35	2.270.836,81	100,00%	5.739.076,21	-1.985.164,39	-9.861.585,24



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIM EMB VI A CRED PRIV CNPJ - 41837660000109

Dados Gerais

PL:	154.200.473,73	VAR / PL:	1,453%
VAR:	2.240.285,66	ETL / PL:	1,8219%
ETL:	2.809.409,56	VAR / CDI:	4180,92%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 5.893.765,88	BAIXA 1:	5.324.968,28	Cenário 1:	4.937.810,64
				Cenário 2:	-1.933.319,22
				Cenário 3:	-8.147.669,81

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	10.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	- 54.062,26	-	-	0,00%	-	-	-
DAPQ22	-	140.191,24	50.535,83	2,26%	121.033,79	- 43.934,99	- 264.226,05
DAPK23	-	395.128,38	139.661,61	6,23%	377.205,57	- 136.232,27	- 813.752,56
D11N23	-	29.769,31	24.424,54	1,09%	45.639,45	- 23.176,35	- 67.710,87
D11F24	-	108.022,88	97.415,91	4,35%	158.202,89	- 79.883,27	- 232.508,48
DAPQ24	-	367.673,85	282.333,79	12,60%	615.924,28	- 221.064,06	-1.309.474,76
D11F25	-	488.392,98	435.868,89	19,46%	689.050,75	- 343.966,30	- 993.621,22
DAPK25	-	125.255,32	120.659,23	5,39%	-	-	-
D11F26	-	369.710,36	318.590,08	-14,22%	- 515.772,94	254.292,11	728.644,60
DAPQ26	-	98.769,80	91.947,43	4,10%	-	-	-
D11F27	-	246.766,84	206.272,20	9,21%	354.438,29	- 172.527,28	- 490.272,28
DAPQ28	-	242.741,29	200.295,42	-8,94%	-	-	-
D11F29	-	145.016,06	114.497,27	5,11%	217.118,85	- 102.951,89	- 287.685,35
DAPQ30	-	1,46	1,13	0,00%	- 3,05	1,06	5,98
DAPK35	-	17.556,88	11.439,59	-0,51%	-	-	-
COMPROMISSADA	13.830.700,66	647,50	202,08	-0,01%	759,39	- 394,28	- 1.169,01
DE252 ALIANSCE CDI - ALSA0	4.080.853,87	47.246,92	39.529,88	1,76%	64.459,24	- 31.553,75	- 89.981,41
DE252 AUTOPIST CDI - APRB28	1.398.759,15	618,04	555,36	0,02%	956,39	- 478,46	- 1.384,38
DE252 BCBF CDI - BCBF15	2.647.836,89	1.996,42	1.745,31	0,08%	3.160,82	- 1.597,01	- 4.650,57
DE252 BKBR CDI - BKBR18	1.473.005,11	562,98	451,23	0,02%	833,58	- 422,67	- 1.233,71
DE252 BRKA CDI - BRKP18	2.706.583,44	3.400,17	3.020,16	0,13%	5.321,27	- 2.686,85	- 7.820,72
DE252 BRML CDI - BRML17	3.231.545,92	6.725,82	5.919,11	-0,26%	- 9.298,17	4.667,41	13.533,47
DE252 CCPR CDI - CCPRA3	2.181.738,87	4.175,45	2.282,04	-0,10%	- 3.268,95	1.531,39	4.231,26
DE252 CEA MODA CDI - CEAB11	2.141.613,13	1.328,80	1.133,06	0,05%	2.068,38	- 1.046,83	- 3.051,80
DE252 CELPA CDI - CELP15	2.594.790,64	314,03	68,83	0,00%	213,44	- 109,59	- 322,60
DE252 CORSAN CDI - RSAN24	1.638.481,83	24.847,44	21.742,22	0,97%	33.660,46	- 16.807,75	- 48.534,71
DE252 COSAN LO CDI - RLOG11	1.674.804,31	1.049,33	893,88	0,04%	1.638,04	- 828,54	- 2.414,51
DE252 CSAN CDI - CSAN23	1.160.007,47	4.391,88	3.802,48	0,17%	6.798,16	- 3.297,63	- 9.354,96
DE252 DASA CDI - DASAA2	2.680.708,92	738,01	535,88	0,02%	1.040,51	- 528,34	- 1.543,63
DE252 ECORODOV CDI - ERDVA0	2.106.524,07	589,10	301,46	0,01%	787,07	- 403,11	- 1.184,42
DE252 ELEKTRO CDI - ELEK27	562.116,58	878,03	719,02	-0,03%	- 1.377,48	705,77	2.074,21
DE252 ENER TR CDI - ETEN13	4.644.644,48	101.026,24	88.575,16	3,95%	162.654,23	- 78.629,39	- 222.631,79
DE252 GUAR CDI - GUAR24	2.743.517,60	2.598,03	2.278,29	0,10%	4.120,99	- 2.082,84	- 6.066,62
DE252 IGUATEMI CDI - IGTA19	2.359.625,89	486,49	214,64	0,01%	618,46	- 317,25	- 933,16
DE252 IGUATEMI CDI - IGTA37	2.156.913,16	4.755,01	4.250,56	-0,19%	- 6.681,81	3.371,91	9.811,09
DE252 LIGHT CDI - LIGHD3	1.669.791,78	3.896,36	3.485,37	0,16%	5.943,65	- 2.934,51	- 8.418,42
DE252 LOCAMERI CDI - LCAMA9	1.931.016,53	1.994,93	1.788,66	0,08%	3.101,17	- 1.562,03	- 4.539,38
DE252 MOV_PART CDI - MOV116	1.118.402,02	1.413,01	1.283,07	0,06%	2.232,57	- 1.119,44	- 3.243,76
DE252 MOV_PART CDI - MOV127	1.218.922,06	4.458,35	3.954,37	0,18%	6.797,07	- 3.342,84	- 9.566,21
DE252 MULTIPLA CDI - MULP16	3.161.699,35	5.059,17	4.557,34	-0,20%	- 7.203,15	3.649,12	10.644,64



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIM EMB VI A CRED PRIV CNPJ - 41837660000109

Dados Gerais

PL:	154.200.473,73	VAR / PL:	1,453%
VAR:	2.240.285,66	ETL / PL:	1,8219%
ETL:	2.809.409,56	VAR / CDI:	4180,92%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 5.893.765,88	BAIXA 1:	5.324.968,28	Cenário 1:	4.937.810,64
				Cenário 2:	-1.933.319,22
				Cenário 3:	-8.147.669,81

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	Var Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 OMEGA GE CDI - OMGE13	2.226.571,74	4.192,40	3.765,70	0,17%	6.462,18	- 3.189,67	- 9.149,27
DE252 OURO VER CDI - OVSA10	1.544.168,49	1.953,87	1.770,88	0,08%	3.025,18	- 1.519,31	- 4.406,85
DE252 RD COLIN CDI - RDCO10	3.237.123,42	53.685,84	46.394,96	2,07%	73.023,03	- 36.473,97	- 105.283,16
DE252 RENNER CDI - LRENB1	1.429.568,59	575,99	457,90	0,02%	857,04	- 434,40	- 1.267,63
DE252 RT BANDE CDI - CBAN22	2.192.123,46	2.607,25	2.371,43	0,11%	4.050,37	- 2.026,11	- 5.861,79
DE252 S LUIZA CDI - RDORB9	1.147.072,09	4.169,44	3.610,01	0,16%	6.455,26	- 3.131,06	- 8.882,00
DE252 SANEAMEN CDI - SNGO18	2.602.136,16	1.671,92	1.438,29	0,06%	2.626,79	- 1.328,00	- 3.868,75
DE252 SBF COME CDI - SBFC11	4.099.647,83	54.765,34	49.096,05	2,19%	74.257,76	- 37.542,16	- 109.256,33
DE252 SIMPAR CDI - JSMLA5	1.194.300,44	6.895,10	6.000,58	0,27%	10.592,45	- 5.159,62	- 14.675,63
DE252 USIMINAS CDI - USIM17	3.427.673,38	14.333,45	11.687,32	0,52%	19.857,27	- 10.177,49	- 29.905,72
DE252 VAMOS CDI - VAMO23	294.623,28	1.474,23	1.276,31	0,06%	2.273,87	- 1.104,40	- 3.135,53
DE252 VIX LOGI CDI - VIXL14	2.148.602,97	1.969,18	1.754,62	0,08%	3.080,75	- 1.552,83	- 4.514,81
LF selic	1.964.534,58	9.561,65	8.624,41	-0,38%	- 13.343,48	6.946,81	20.634,48
LF252 ABC CDI - LF002100BMM	1.057.934,55	96,42	0,58	0,00%	0,01	0,00	0,01
LF252 ABC CDI - LF002100BMX	1.057.934,55	96,42	0,58	0,00%	0,01	0,00	0,01
LF252 CNH CDI - LF0021003Q1	1.969.999,06	179,54	1,07	0,00%	0,02	0,00	0,03
LF252 PANAMERI CDI - LF002100E1F	1.056.016,28	96,24	0,58	0,00%	0,01	0,00	0,01
LF252 PARANA B CDI - LF002100BC4	1.595.372,04	145,40	0,87	0,00%	0,02	0,00	0,02
LFSN BRADESCO CDI - LFSN210029N	3.476.750,94	316,86	1,89	0,00%	0,03	0,00	0,05
DE252 LIGHT IPCA - LSVE29	1.341.864,29	10.162,74	2.014,08	0,09%	9.467,43	- 3.402,34	- 20.410,15
DE252 LOCAMERI IPCA - LCAMD1	5.681.034,16	129.913,72	115.608,82	5,16%	292.955,53	- 101.128,55	- 545.090,90
DE252 MOV_PART IPCA - MOVI37	1.805.685,51	42.446,25	37.915,22	1,69%	93.815,83	- 33.148,29	- 171.905,06
DE252 SIMPAR IPCA M D - JSMLB5	923.774,75	22.035,04	19.696,50	0,88%	48.411,27	- 17.211,54	- 88.336,25
DE252 VAMOS IPCA - VAMO33	272.327,71	6.320,55	5.639,73	0,25%	14.307,51	- 4.932,11	- 26.790,38
DEBI ANEMUS IPCA - ANEM11	3.000.463,78	80.848,32	69.655,10	3,11%	178.763,07	- 61.340,88	- 314.995,93
DEBI CART IPCA - CART13	1.699.629,97	40.533,38	35.631,85	1,59%	90.469,17	- 31.169,24	- 165.473,07
DEBI CORSAN IPCA - RSAN44	764.291,50	12.632,44	12.053,27	0,54%	29.101,00	- 9.885,01	- 57.469,54
DEBI ECHOENER IPCA - ECHP11	1.259.314,54	41.003,82	36.358,99	1,62%	81.305,06	- 32.689,83	- 132.108,50
DEBI ECHOENER IPCA - ECHP22	1.715.088,94	24.194,64	23.127,83	1,03%	57.135,23	- 19.501,71	- 113.975,48
DEBI ENSINOP IPCA - CSNP12	1.759.307,78	33.650,53	31.878,74	1,42%	76.378,89	- 27.266,21	- 142.897,25
DEBI HAZTEC IPCA - HZTC14	2.227.153,78	52.648,98	46.569,31	2,08%	117.684,02	- 40.483,07	- 215.517,20
DEBI HOLDARAG IPCA - HARG11	823.914,78	22.153,05	18.825,42	0,84%	48.368,53	- 16.403,58	- 86.648,64
DEBI METRORIO IPCA - MTRJ19	2.542.022,06	47.311,81	45.620,71	2,04%	110.192,74	- 38.909,73	- 210.540,39
DEBI NORTE EN IPCA - NTEN11	2.886.348,10	50.564,65	48.755,70	2,18%	113.373,83	- 40.339,81	- 218.656,73
DEBI PARANAGU IPCA - PASN12	1.902.891,07	26.109,86	25.449,59	1,14%	61.058,78	- 21.411,94	- 120.725,69
DEBI TUCANOHO IPCA - TNH11	1.692.832,79	52.183,71	43.598,75	1,95%	111.988,28	- 37.567,17	- 198.264,54
DEBI UTE GNA IPCA - UNEG11	4.214.138,14	135.452,73	107.172,14	4,78%	289.323,34	- 94.406,89	- 509.715,99
LF ipca	1.362.393,47	7.262,78	2.971,46	0,13%	11.309,64	- 4.095,82	- 24.555,80
NTNB	10.054.056,37	215.304,17	176.491,85	7,88%	571.426,60	- 195.672,52	- 1.095.634,17
IDIJQF5	- 3,58	14,25	3,47	0,00%	1,18	3,54	2,03
IDIJQF6	3,58	15,06	3,66	0,00%	- 1,24	3,55	- 2,10



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIM EMB VI A CRED PRIV CNPJ - 41837660000109

Dados Gerais

PL:	154.200.473,73	VAR / PL:	1,453%
VAR:	2.240.285,66	ETL / PL:	1,8219%
ETL:	2.809.409,56	VAR / CDI:	4180,92%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 5.893.765,88	BAIXA 1:	5.324.968,28	Cenário 1:	4.937.810,64
				Cenário 2:	-1.933.319,22
				Cenário 3:	-8.147.669,81

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
BR ELETRO FIDC S1	12.510,60	77.172,25	20.053,91	0,90%	- 11.884,64	-	720.040,95
FARM SYN AGRO FIDC	3.263.153,07	18.720,30	2.655,77	0,12%	10.398,73	- -	14.077,90
FIDC VERDECARD SN4	1.750.001,17	151,64	0,47	0,00%	- 4.330,12	-	5.901,42
RB CAP CREDIT AL SN4	795.062,00	4.549,33	826,55	0,04%	1.399,15	- -	1.897,37
Total	158.541.955,63	4.312.336,67	2.240.285,66	100,00%	4.937.810,64	-1.933.319,22	-8.147.669,81



Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIM EMB VII A CRED PRIV CNPJ - 41687175000104

Dados Gerais

PL:	241.821.112,92	VAR / PL:	1,828%
VAR:	4.419.996,52	ETL / PL:	2,2921%
ETL:	5.542.855,85	VAR / CDI:	5259,96%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 11.452.300,44	BAIXA 1:	10.393.637,59	Cenário 1:	10.086.180,30
				Cenário 2:	- 3.470.862,72
				Cenário 3:	-19.009.069,64

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	- 126.740,53	-	-	0,00%	-	-	-
CNRD11	78.302,00	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	962.348,33	45,05 -	27,61	0,00%	52,84 -	27,43 -	81,34
LFT	791.505,28	488,62 -	304,57	-0,01%	0,01	- -	0,01
CRI REIT SEC IPCA - 21K0001807	2.533.133,34	87.946,57	82.515,50	1,87%	181.552,96 -	59.341,04 -	316.601,22
DE252 CSAN IPCA - CSAN33	5.566.700,94	122.123,88	121.373,93	2,75%	277.703,24 -	94.251,46 -	523.446,65
DE252 IRB IPCA - IRBR12	9.370.849,51	142.762,91	127.871,21	2,89%	301.710,38 -	107.668,42 -	605.417,09
DE252 LIGHT IPCA - LIGHD7	4.718.673,34	71.247,91	61.391,43	1,39%	147.120,35 -	51.791,88 -	300.935,96
DE252 LIGHT IPCA - LSVE29	3.075.965,83	23.296,14 -	874,25	-0,02%	21.702,27 -	7.799,21 -	46.786,34
DE252 LOCALIZA IPCA - LORTA7	8.711.615,02	197.100,88	196.014,65	4,43%	452.104,68 -	151.823,79 -	852.029,62
DE252 LOCAMERI IPCA - LCAMD1	4.484.608,36	102.553,89	101.887,33	2,31%	231.259,10 -	79.830,88 -	430.294,76
DE252 MOV_PART IPCA - MOVI37	1.194.160,02	28.071,12	27.824,86	0,63%	62.043,53 -	21.922,07 -	113.686,55
DE252 MOVIDA L IPCA - MVLV16	6.061.378,12	164.094,29	159.118,70	3,60%	342.806,99 -	120.437,73 -	693.525,89
DE252 VAMOS IPCA - VAMO33	5.403.327,59	125.407,79	124.427,48	2,82%	283.879,22 -	97.859,31 -	531.555,21
DE252 VAMOS IPCA - VAMO34	2.349.754,77	57.172,24	56.657,44	1,28%	126.295,49 -	44.637,47 -	230.871,36
DEBI AESTUCAN IPCA - TCII11	4.842.248,91	149.428,95	145.311,29	3,29%	324.973,21 -	107.120,81 -	576.534,19
DEBI ANEMUS IPCA - ANEM11	9.771.681,54	263.300,65	258.676,13	5,85%	582.181,92 -	199.770,30 -	1.025.854,70
DEBI ANET IPCA - ANET11	6.534.838,47	85.703,35	73.209,52	1,66%	188.322,48 -	65.974,86 -	379.153,92
DEBI B2W IPCA - BTOW15	6.695.396,89	165.811,51	164.396,16	3,72%	369.313,07 -	128.509,07 -	680.401,44
DEBI BRISANET IPCA - BRST11	5.568.500,19	82.382,45	74.876,73	1,69%	177.798,31 -	62.528,65 -	357.189,42
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	6.975.399,40	169.127,22	165.206,41	3,74%	384.370,46 -	122.344,31 -	728.729,11
DEBI CAGECE IPCA - CAEC21	4.864.775,90	67.727,62	23.990,17	0,54%	123.558,07 -	30.158,74 -	298.105,51
DEBI CART IPCA - CART13	2.832.716,62	67.555,63	67.161,67	1,52%	150.781,94 -	51.948,73 -	275.788,44
DEBI CEEE D IPCA - CEED21	4.134.485,34	79.721,95	78.496,07	1,78%	180.753,51 -	61.874,52 -	350.471,11
DEBI CELP IPCA - CEPEC1	2.156.313,39	49.582,59	49.303,98	1,12%	113.361,56 -	38.508,37 -	212.635,47
DEBI COELBA IPCA - CEEBC3	2.150.288,48	49.365,40	49.090,50	1,11%	112.984,58 -	38.329,78 -	212.103,62
DEBI COMGAS IPCA - GASP19	3.296.911,24	71.678,79	71.343,56	1,61%	166.530,79 -	55.633,76 -	317.483,10
DEBI CORSAN IPCA - RSAN44	4.910.572,87	81.163,46	79.052,64	1,79%	186.973,93 -	63.511,16 -	369.241,78
DEBI CTEEP IPCA - CTEE29	883.018,95	23.751,27	22.859,11	0,52%	52.566,01 -	16.709,67 -	93.524,77
DEBI EDPM IPCA - MGSP12	4.567.185,39	108.384,76	105.876,41	2,40%	249.892,97 -	78.751,93 -	467.261,49
DEBI ELEKTRO IPCA - EKTRC0	2.144.250,80	49.147,95	48.876,57	1,11%	112.606,83 -	38.150,82 -	211.570,66
DEBI ENERGISA IPCA - ENGIAS	3.052.845,45	70.644,24	70.230,56	1,59%	160.833,96 -	54.919,77 -	300.691,61
DEBI HIDRO BR IPCA - HBSA21	4.202.273,02	98.127,00	97.544,18	2,21%	223.377,54 -	76.196,36 -	417.880,66
DEBI HOLDARAG IPCA - HARG11	6.547.667,15	176.050,75	173.144,92	3,92%	384.385,65 -	130.359,57 -	688.598,43
DEBI LAME IPCA - LAMEA6	7.038.268,07	168.122,52	166.709,84	3,77%	372.671,91 -	131.038,40 -	684.262,90
DEBI METRORIO IPCA - MTRJ19	7.499.344,15	139.576,90	136.868,28	3,10%	325.085,02 -	114.789,50 -	621.125,54
DEBI MG050 IPCA - CRMG15	4.192.511,09	70.543,53	68.714,54	1,55%	165.587,22 -	57.405,20 -	321.501,19
DEBI NORTE EN IPCA - NTEN11	4.350.794,70	76.219,64	74.055,47	1,68%	170.896,32 -	60.807,02 -	329.596,61
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS11	1.196.307,17	15.778,08	13.687,97	0,31%	34.511,43 -	12.207,72 -	69.146,05
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS21	3.509.183,86	103.436,82	100.915,18	2,28%	220.065,50 -	76.090,10 -	386.322,30



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIM EMB VII A CRED PRIV CNPJ - 41687175000104

Dados Gerais

PL:	241.821.112,92	VAR / PL:	1,828%
VAR:	4.419.996,52	ETL / PL:	2,2921%
ETL:	5.542.855,85	VAR / CDI:	5259,96%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 11.452.300,44	BAIXA 1:	10.393.637,59	Cenário 1:	10.086.180,30
				Cenário 2:	- 3.470.862,72
				Cenário 3:	-19.009.069,64

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS22	2.463.759,34	58.608,00	58.249,90	1,32%	133.561,08 - 44.943,08	- 248.881,75	
DEBI QUATA IPCA - QUAT12	6.546.790,95	92.985,67	76.257,69	1,73%	186.180,52 - 67.003,25	- 376.775,96	
DEBI RT BANDE IPCA - CBAN32	280.660,01	6.853,27	6.797,87	0,15%	15.658,91 - 5.170,97	- 29.385,63	
DEBI RT BANDE IPCA - CBAN72	4.700.052,81	114.767,74	113.840,10	2,58%	262.230,79 - 86.595,20	- 492.104,33	
DEBI TAUBATE IPCA - LTTE15	9.454.265,28	189.886,51	187.570,07	4,24%	443.597,29 - 144.753,64	- 827.848,93	
DEBI TESC IPCA - CJEN13	9.827.674,64	251.711,17	249.471,83	5,64%	546.519,80 - 193.368,61	- 977.242,06	
DEBI TUCANOHO IPCA - TNHL11	3.475.524,85	107.137,44	104.825,72	2,37%	229.921,15 - 77.128,48	- 407.053,40	
DEBI VENSJOR IPCA - VSJH11	1.198.628,51	16.950,14	15.254,24	0,35%	37.697,40 - 13.772,65	- 73.597,22	
DEBI VIARONDO IPCA - VRDN12	7.249.781,92	165.638,47	165.090,25	3,74%	378.985,22 - 126.758,42	- 710.324,43	
FIDC CELG DIST SN B	3.136.374,15	79.695,30	7.477,91	0,17%	- 85.659,12 - 338,58	120.269,86	
FIDC CREDZ MZ4	840.878,78	11.388,07	1.218,15	-0,03%	- 1.330,71	- 1.811,68	
FIDC VERDECARD SN4	5.286.670,19	458,10	169,10	0,00%	- 13.081,09	- 17.827,90	
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	2.360.464,90	42.794,39	1.263,98	-0,03%	- 10.716,20	- 14.640,61	
Total	225.915.887,29	4.743.518,58	4.419.996,52	100,00%	10.086.180,30 - 3.470.862,72	-19.009.069,64	



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIM EMB III A IMOBILIÁRIO CNPJ - 32711990000162

Dados Gerais

PL:	88.471.825,83	VAR / PL:	1,718%
VAR:	1.519.665,69	ETL / PL:	2,1540%
ETL:	1.905.722,73	VAR / CDI:	4943,08%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	19,56	BAIXA 1:	19,99	Cenário 1:	-5.814.899,29
					Cenário 2:	- 19.980,69
					Cenário 3:	8.784.927,69

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	56,73	- 7,62	0,00%	- 27,45	- 0,11	38,55
CONTAS A PAGAR / RECEBER	- 48.313,93	2.741,06	367,91	0,02%	1.326,28	5,24	- 1.862,48
AIEC11	2.136.905,40	237.214,12	- 193.857,68	-12,76%	111.167,74	- 231,88	- 128.541,99
BLCP11	1.260.750,36	311.225,12	231.368,28	15,22%	- 188.584,54	136,81	292.730,32
BMLC11	1.986.348,00	153.519,74	23.942,41	1,58%	- 34.066,67	215,55	49.102,22
BPML11	1.089.352,92	75.305,06	1.503,53	0,10%	- 144.884,73	591,84	220.289,07
CBOP11	47.878,30	7.854,28	- 6.089,23	-0,40%	5.670,65	20,23	- 6.243,03
CEOC11	827.660,00	39.905,41	18.764,33	1,23%	- 75.420,02	- 302,08	109.309,57
CNES11	507.627,78	30.247,72	- 4.576,57	-0,30%	- 16.777,88	66,20	23.457,65
GALG11	1.262.935,80	37.422,49	- 3.013,76	-0,20%	- 56.519,30	- 137,05	78.995,56
GALG13	492,10	25,22	- 5,02	0,00%	- 13,51	- 0,05	18,97
GSFI11	498.474,40	20.487,30	- 10.150,87	-0,67%	- 13.683,77	54,09	19.215,98
HBRH11	2.092.360,00	358.889,17	245.576,85	16,16%	- 176.498,78	- 227,05	254.047,12
HSML11	8.435.626,74	596.428,18	105.624,71	6,95%	-1.286.460,73	- 5.307,72	2.004.370,49
JRDM11	1.142.067,80	93.998,00	46.326,91	3,05%	- 188.824,59	784,34	299.136,86
LVB11	3.908.681,94	248.587,28	109.679,66	7,22%	- 312.260,16	- 1.244,85	447.498,92
MALL11	7.847.522,25	406.900,92	151.380,56	9,96%	- 493.762,62	- 1.956,34	697.228,17
MAXR11	1.433.971,95	40.530,56	- 13.381,16	-0,88%	- 69.365,84	- 273,81	97.078,12
NEWU11	387.789,48	184.721,82	145.739,94	9,59%	- 102.693,97	- 42,08	187.584,87
PATC11	8.298.330,74	342.074,47	- 254.602,34	-16,75%	- 185.278,93	- 735,13	262.462,75
QAGR11	8.591.643,17	428.617,83	- 332.226,31	-21,86%	- 131.816,00	- 932,31	191.822,37
RBRL11	1.870.467,76	159.443,97	- 67.252,92	-4,43%	- 153.463,50	202,97	220.388,10
RCRB11	1.537.761,00	179.720,44	95.238,73	6,27%	29.501,69	106,43	- 33.079,59
RNGO11	136.468,68	6.900,90	2.590,88	0,17%	- 5.518,54	- 21,76	7.706,62
SDIL11	360.820,07	12.236,90	3.341,84	0,22%	- 27.639,77	- 110,05	39.487,59
TEPP11	8.137.531,50	462.008,03	320.801,22	21,11%	- 397.791,54	- 1.570,34	556.836,48
TRXF11	13.365.835,00	295.431,12	13.577,63	0,89%	- 592.127,50	- 2.335,88	827.495,34
VISC11	6.685,80	142,11	14,59	0,00%	- 516,63	- 2,06	738,54
VVPR11	1.254.258,40	125.530,15	63.712,53	4,19%	- 68.864,34	- 136,10	96.705,64
XPIN11	3.741.813,67	205.109,13	111.953,62	7,37%	- 382.032,13	- 406,04	560.262,70
XPPR11	3.356.248,40	215.489,99	142.193,00	9,36%	- 355.244,75	- 364,20	523.155,23
COMPROMISSADA	675.564,99	38.319,99	- 5.170,27	-0,34%	- 18.508,04	- 92,57	25.985,65
FII HSI LOGISTICA	1.179.667,50	99.062,13	34.769,35	2,29%	- 147.294,58	- 128,01	221.757,26
FII VIA PQ SHOPPING	1.161.028,50	676.717,65	541.530,92	35,63%	- 336.624,86	- 1.503,34	639.748,05
Total	88.493.256,47	6.092.865,01	1.519.665,69	100,00%	-5.814.899,29	- 19.980,69	8.784.927,69



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	434.531.889,71	VAR / PL:	9,410%
VAR:	40.890.878,06	ETL / PL:	11,8009%
ETL:	51.278.828,35	VAR / CDI:	27080,67%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	272,55	BAIXA 1:	280,05	Cenário 1:	74.752.037,94
					Cenário 2:	245.460,06
					Cenário 3:	-75.313.069,14

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	10.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	1.115.957,35	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	16.809.887,85	1.527.741,91	743.053,58	-1,82%	158.339,94	620,23	217.583,92
AMER3	4.818.302,79	757.759,66	376.562,71	0,92%	559.844,50	-	668.550,71
ASAI3	4.053.455,00	572.578,53	326.405,81	0,80%	364.635,02	-	447.751,35
B3SA3	16.991.787,98	4.258.601,22	3.880.944,30	9,49%	7.966.514,95	25.488,78	6.914.686,91
Banco BTG Pactual SA UNT	10.784.654,00	2.018.277,77	1.783.707,50	4,36%	3.178.594,31	10.866,05	3.192.507,09
BBAS3	13.596.358,00	1.946.114,64	1.445.676,48	3,54%	4.030.326,66	13.768,35	4.041.826,48
BBDC4	27.209.314,80	4.015.676,92	3.340.657,36	8,17%	6.203.840,10	21.796,48	6.626.536,94
BBSE3	2.408.874,00	258.585,32	89.761,78	0,22%	361.066,84	1.312,02	416.420,68
BPAN4	2.205.674,00	364.657,13	304.010,50	0,74%	460.726,64	1.631,83	501.202,73
CASH3	2.101.020,00	518.891,45	362.304,75	0,89%	337.695,43	-	385.217,16
CESP6	3.088.254,00	474.548,81	235.615,45	0,58%	682.054,72	2.403,54	733.500,05
CPFE3	5.800.465,00	492.094,56	324.421,31	0,79%	716.191,08	2.633,40	848.766,69
CSED3	2.586.250,00	620.479,85	159.708,16	-0,39%	166.674,58	-	245.045,96
CYRE3	3.031.032,00	558.571,59	498.423,41	1,22%	776.564,51	2.696,59	807.837,53
EGIE3	5.026.450,00	241.366,28	139.227,56	0,34%	450.484,79	1.682,27	553.368,87
ELET6	4.241.040,00	498.329,17	460.301,89	1,13%	767.524,11	2.751,23	858.021,82
ENEV3	2.174.366,00	230.565,47	2.659,02	0,01%	149.075,56	562,21	187.367,33
GGBR4	7.210.560,00	730.175,25	175.913,09	0,43%	748.906,74	2.778,38	906.042,15
GNDI3	7.127.120,00	1.468.378,53	1.243.350,57	3,04%	2.486.953,97	8.321,84	2.381.792,43
HAPV3	11.683.914,00	2.806.552,24	2.356.379,84	5,76%	4.991.157,69	16.214,01	4.478.374,23
INTB3	3.486.820,00	533.587,24	407.101,43	1,00%	795.049,65	-	849.210,93
ITSA4	11.657.105,25	1.733.235,00	1.493.273,59	3,65%	2.127.111,26	7.619,79	2.374.399,03
ITUB4	29.226.691,21	5.919.717,98	4.746.310,55	11,61%	6.125.791,47	21.690,17	6.659.376,67
JBSS3	14.043.018,00	1.309.425,20	845.413,25	-2,07%	1.530.150,56	6.314,84	2.383.525,65
LREN3	8.192.762,00	1.969.672,92	1.485.715,91	3,63%	4.035.436,71	12.802,06	3.438.598,31
LWSA3	1.998.200,00	568.967,37	162.872,33	-0,40%	327.749,26	1.395,17	550.791,97
MGLU3	5.611.900,00	2.144.180,02	1.131.966,64	2,77%	576.980,99	2.141,58	698.821,31
MOVI3	7.531.360,00	1.598.844,16	554.075,58	1,36%	2.079.017,19	7.160,96	2.123.682,03
MULT3	5.207.300,00	899.378,75	680.157,53	1,66%	2.013.140,17	6.639,85	1.867.538,63
NTCO3	3.482.180,00	625.478,30	281.965,35	0,69%	26.106,98	102,16	35.793,11
PETR3	24.396.259,00	3.201.201,46	2.632.051,44	6,44%	5.685.351,97	19.932,73	6.043.831,08
PETR4	32.413.373,65	4.387.103,28	3.670.217,73	8,98%	8.363.994,50	29.021,66	8.686.043,80
PRIO3	6.963.112,00	1.791.523,38	1.230.662,28	3,01%	2.364.646,31	7.941,38	2.282.973,77
RADL3	6.098.028,00	866.450,25	277.144,97	-0,68%	305.684,12	1.222,54	441.411,49
RAPT4	3.156.888,00	387.321,71	351.738,82	0,86%	602.965,92	2.152,02	667.441,98
RENT3	2.191.640,00	350.380,15	206.515,99	0,51%	457.684,42	1.621,09	497.917,51
STBP3	6.892.750,00	1.379.529,94	923.872,42	2,26%	1.239.109,54	4.443,97	1.386.864,22
SUZB3	14.065.920,00	1.221.836,27	301.381,51	-0,74%	405.244,44	1.603,02	570.021,92
TIMS3	2.326.231,00	221.553,80	36.520,91	-0,09%	138.719,30	525,37	176.078,37



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	434.531.889,71	VAR / PL:	9,410%
VAR:	40.890.878,06	ETL / PL:	11,8009%
ETL:	51.278.828,35	VAR / CDI:	27080,67%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	272,55	BAIXA 1:	280,05	Cenário 1:	74.752.037,94
					Cenário 2:	245.460,06
					Cenário 3:	-75.313.069,14

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
TOTS3	5.380.362,81	703.737,48	297.771,94	0,73%	950.120,70	3.412,24	- 1.066.772,53
USIM5	6.239.479,00	1.021.814,05	717.903,25	1,76%	765.124,81	2.814,40	- 907.558,04
VALE3	57.142.337,65	7.662.778,81	4.465.123,63	10,92%	2.334.841,24	8.922,38	- 3.026.604,46
VBBR3	4.257.110,00	515.469,03	423.416,38	1,04%	915.440,85	-	- 989.984,98
WEGE3	9.310.320,00	1.051.336,02	370.591,95	0,91%	868.784,28	3.238,81	- 1.062.975,60
COMPROMISSADA	9.182.814,15	429,90	216,71	0,00%	504,19	- 261,78	- 776,16
EMP AÇÃO PROVISÃO	8.658,70	4,49	0,30	0,00%	14,77	- 7,65	- 22,63
Total	434.537.357,19	66.424.903,24	40.890.878,06	100,00%	74.752.037,94	245.460,06	-75.313.069,14



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	101.766.463,55	VAR / PL:	10,668%
VAR:	10.856.117,71	ETL / PL:	13,3777%
ETL:	13.614.014,25	VAR / CDI:	30699,01%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	156,74	BAIXA 1:	160,19	Cenário 1:	18.096.473,37
					Cenário 2:	55.561,47
					Cenário 3:	-18.469.304,55

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	- 951.141,46	-	-	0,00%	-	-	-
ALSO3	2.699.997,00	327.788,28	215.941,26	1,99%	500.534,31	1.790,77	557.122,97
AMER3	894.222,00	140.631,54	105.114,51	0,97%	103.900,75	-	124.075,38
ASAI3	945.827,05	133.604,61	49.673,31	0,46%	85.083,38	-	104.477,62
B3SA3	2.018.671,12	505.933,53	416.311,23	3,83%	946.443,87	3.028,14	821.483,81
Banco BTG Pactual SA UNT	2.271.980,00	425.186,26	289.175,63	2,66%	669.627,67	2.289,13	672.558,64
BBDC4	1.178.760,00	173.966,87	127.949,14	1,18%	268.762,32	944,27	287.074,36
BBRK3	26.880,00	8.125,45	7.071,23	0,07%	6.973,44	24,18	7.232,67
BBSE3	724.282,00	77.749,48	16.334,14	0,15%	108.562,85	394,49	125.206,22
BIDI11	1.301.598,00	242.897,80	89.979,39	0,83%	331.057,21	1.150,46	344.982,76
BMGB4	197.192,00	33.334,40	19.128,97	0,18%	- 5.873,55	23,25	8.271,62
BRML3	4.017.799,71	732.003,90	633.230,04	5,83%	1.403.761,28	4.696,46	1.343.891,30
BRPR3	388.064,00	37.684,95	16.254,28	0,15%	51.509,07	188,61	60.459,96
CESP6	3.227.481,62	495.942,88	263.777,64	2,43%	712.803,76	2.511,89	766.568,41
CPFE3	1.533.290,00	130.079,86	47.187,81	0,43%	189.317,34	696,11	224.362,27
CRFB3	1.769.287,12	195.188,28	125.912,46	1,16%	237.007,85	867,36	277.842,15
CSED3	116.875,00	28.040,05	8.065,60	-0,07%	- 7.532,18	-	11.073,85
CYRE3	1.629.677,88	300.324,03	245.644,39	2,26%	417.531,06	1.449,86	434.345,45
ELET3	684.626,00	83.021,69	58.674,46	0,54%	140.920,34	499,77	153.752,41
ELET6	2.361.880,00	277.524,78	212.071,75	1,95%	427.442,29	1.532,19	477.841,42
ENEV3	2.003.957,00	212.495,64	19.516,84	-0,18%	137.392,23	518,15	172.683,01
ENJU3	103.620,00	24.535,20	17.051,72	0,16%	35.825,23	-	34.405,05
EQTL3	5.308.352,00	286.184,03	133.817,38	1,23%	375.837,14	1.415,90	471.214,33
ESPA3	42.174,00	6.335,34	1.137,03	0,01%	- 4.287,10	-	6.613,59
EUCATEX PN	128.843,00	12.961,64	383,59	0,00%	4.676,55	17,91	6.093,54
GNDI3	726.240,00	149.624,98	116.032,58	1,07%	253.415,89	847,98	242.700,13
GOAU4	983.450,00	83.794,13	6.725,58	0,06%	96.660,15	359,52	117.637,84
HAPV3	880.882,80	211.593,79	157.537,23	1,45%	376.297,27	1.222,42	337.637,10
HBSA3	404.800,71	78.970,06	4.973,97	0,05%	- 53.959,47	-	86.865,67
HYPE3	4.561.348,20	458.150,42	385.574,71	3,55%	696.483,87	2.527,69	800.975,95
IGTH1	849.400,00	162.017,99	75.893,50	0,70%	-	-	-
ITSA4	3.441.163,00	511.648,82	419.976,00	3,87%	627.920,60	2.249,35	700.919,65
ITUB4	1.815.147,80	367.648,98	284.536,67	2,62%	380.447,34	1.347,09	413.586,09
LCAM3	1.665.605,00	265.901,97	77.467,61	0,71%	346.951,90	1.229,16	377.643,35
LREN3	2.618.703,12	629.578,72	403.944,27	3,72%	1.289.871,56	4.092,00	1.099.100,42
LWSA3	273.540,00	77.887,77	24.588,25	-0,23%	- 44.866,65	- 190,99	75.399,68
MATD3	238.350,00	93.449,33	36.167,99	-0,33%	25.953,92	-	31.232,73
MDNE3	106.602,00	28.014,62	24.204,06	0,22%	38.461,13	128,11	36.463,58
MEGA3	951.343,32	6.375.471,27	2.897.268,09	26,69%	-	-	-
MRVE3	237.357,00	36.670,83	27.617,65	0,25%	66.635,61	229,08	67.777,47



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	101.766.463,55	VAR / PL:	10,668%
VAR:	10.856.117,71	ETL / PL:	13,3777%
ETL:	13.614.014,25	VAR / CDI:	30699,01%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	156,74	BAIXA 1:	160,19	Cenário 1:	18.096.473,37
					Cenário 2:	55.561,47
					Cenário 3:	-18.469.304,55

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
MULT3	417.100,00	72.039,42	43.238,22	0,40%	161.250,70	531,85	- 149.588,15
NINJ3	63.373,00	23.225,09	11.977,74	0,11%	- 9.780,74	-	16.212,71
NTCO3	4.452.037,50	799.686,65	463.159,36	4,27%	- 33.378,30	- 130,62	45.762,22
PARD3	854.511,30	164.539,39	128.618,46	1,18%	316.920,20	1.051,56	- 297.902,77
PETR4	3.293.230,00	445.733,92	254.727,57	2,35%	849.789,90	2.948,63	- 882.510,42
POWE3	38.255,00	5.473,28	3.611,81	0,03%	2.497,56	-	3.150,42
PRI03	1.801.176,00	463.420,51	355.713,60	3,28%	611.672,51	2.054,23	- 590.545,95
QUAL3	132.480,00	19.495,02	17.893,46	0,16%	25.931,55	92,36	- 28.571,73
RAIL3	2.765.052,40	331.705,27	117.893,68	-1,09%	- 16.524,44	- 64,62	22.614,38
RECV3	1.803.360,00	478.400,12	384.153,49	3,54%	140.606,75	-	- 174.912,99
RENT3	4.152.806,20	663.914,18	188.266,69	1,73%	867.238,54	3.071,71	- 943.473,80
SEER3	885.116,57	141.835,80	114.811,62	1,06%	264.897,58	903,91	- 264.976,23
SOMA3	3.274.288,50	701.785,00	437.073,91	4,03%	1.323.735,18	4.337,03	- 1.210.137,29
SULA11	1.838.020,20	201.989,22	43.666,19	-0,40%	47.219,66	181,78	- 62.276,85
SUZB3	4.136.659,20	359.330,94	124.054,16	-1,14%	- 119.178,71	- 471,43	167.638,26
TEND3	1.964.427,00	267.730,98	15.496,22	0,14%	325.448,81	1.174,39	- 369.408,25
USIM5	1.137.064,00	186.212,34	116.968,92	1,08%	139.434,06	512,89	- 165.390,66
VALE3	817.919,18	109.682,84	57.425,28	0,53%	33.420,25	127,71	- 43.321,96
VBBR3	6.620.298,40	801.613,96	513.936,66	4,73%	1.423.616,39	-	- 1.539.541,14
WEST3	98.099,00	49.342,19	39.367,39	0,36%	33.228,40	-	32.104,97
YDUQ3	1.426.095,00	250.424,67	109.884,12	1,01%	470.580,02	1.586,34	- 458.137,37
COMPROMISSADA	5.414.085,61	253,47	172,60	0,00%	297,27	- 154,34	- 457,61
Total	101.764.582,05	20.959.798,41	10.856.117,71	100,00%	18.096.473,37	55.561,47	-18.469.304,55



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIA RVA EMB IV CNPJ - 38452613000132

Dados Gerais

PL:	94.406.345,98	VAR / PL:	12,783%
VAR:	12.067.935,86	ETL / PL:	16,0304%
ETL:	15.133.683,62	VAR / CDI:	36786,32%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	228,78	BAIXA 1:	233,81	Cenário 1:	16.402.568,88
					Cenário 2:	51.214,21
					Cenário 3:	-16.560.018,06

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	1.262.110,96	-	-	0,00%	-	-	-
Banco BTG Pactual SA UNT	6.392.650,79	1.196.342,97	503.155,74	4,17%	1.884.125,67	6.440,90	- 1.892.372,53
BIDI11	1.056.736,50	197.202,95	23.469,41	0,19%	268.777,49	934,03	- 280.083,31
BIDI3	351,56	57,94	4,12	0,00%	71,40	0,25	- 78,11
BIDI4	7.586,32	1.357,99	158,21	0,00%	1.839,81	6,42	- 1.938,46
BRML3	5.227.972,92	952.485,64	663.256,92	5,50%	1.826.578,34	6.111,04	- 1.748.675,36
CESP6	4.824.779,69	741.387,68	369.007,87	3,06%	1.065.574,19	3.755,05	- 1.145.947,25
CLSA3	4.047.472,00	-	-	0,00%	-	-	-
ELET3	1.268.746,08	153.855,46	69.105,72	0,57%	261.153,00	926,17	- 284.933,34
ELET6	640.776,32	75.292,27	39.757,03	0,33%	115.964,78	415,68	- 129.638,03
EQTL3	7.544.610,08	406.745,24	68.615,26	0,57%	534.166,66	2.012,38	- 669.723,56
GGPS3	4.324.145,40	687.349,63	43.711,92	-0,36%	615.627,10	-	- 715.477,79
GMAT3	6.117.423,65	706.958,10	433.323,70	3,59%	571.334,88	2.129,85	- 698.979,65
GNDI3	6.717.791,20	1.384.045,78	809.331,61	6,71%	2.344.121,81	7.843,89	- 2.244.999,97
HAPV3	1.877.642,58	451.021,98	242.726,37	2,01%	802.095,10	2.605,64	- 719.689,15
INTB3	2.442.370,30	373.755,35	143.697,09	1,19%	556.898,73	-	- 594.836,43
MATD3	2.667.692,65	1.045.916,06	565.021,01	-4,68%	290.484,87	-	- 349.567,17
MEGA3	1.559.339,64	10.449.986,73	7.640.175,81	63,31%	-	-	-
MULT3	2.706.054,50	467.376,16	157.980,62	1,31%	1.046.159,62	3.450,50	- 970.495,52
NTCO3	3.766.701,80	676.584,85	404.696,07	3,35%	- 28.240,13	110,51	38.717,70
PETRA	5.831.572,75	789.294,94	261.436,19	2,17%	1.504.787,59	5.221,36	- 1.562.728,30
PRIO3	7.330.068,72	1.885.936,85	1.471.215,74	12,19%	2.489.263,42	8.359,89	- 2.403.286,72
RAIL3	8.096.408,32	971.273,20	447.467,06	-3,71%	- 48.385,55	189,20	66.217,65
UGPA3	2.550.492,45	385.146,73	74.307,01	-0,62%	422.953,91	1.526,14	- 480.006,13
VITT3	531.031,17	156.453,91	102.948,53	-0,85%	- 123.217,72	-	229.171,32
COMPROMISSADA	7.902.500,18	369,96	277,91	0,00%	433,90	225,28	- 667,94
Total	96.696.028,53	24.156.198,38	12.067.935,86	100,00%	16.402.568,88	51.214,21	-16.560.018,06



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	112.761.090,15	VAR / PL:	8,343%
VAR:	9.407.607,15	ETL / PL:	10,4624%
ETL:	11.797.522,95	VAR / CDI:	24009,02%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	887,51	BAIXA 1:	1.009,14	Cenário 1:	16.665.973,00
					Cenário 2:	54.063,63
					Cenário 3:	-16.964.032,68

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	338.370,19	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	3.367.521,22	312.802,07	165.503,44	-1,76%	11.438,35	44,67	15.606,07
ALPA4	249.780,00	34.024,20	10.448,47	-0,11%	16.895,34	68,19	24.940,45
AMER3	904.859,28	146.890,12	73.715,36	0,78%	120.314,70	-	141.188,35
ASAI3	507.270,50	71.298,97	39.573,21	0,42%	56.747,03	-	68.074,64
AZUL4	456.685,15	101.536,74	80.155,15	0,85%	85.334,24	305,11	94.844,28
B3SA3	4.624.984,54	1.077.529,26	931.667,09	9,90%	2.044.053,43	6.604,18	1.812.375,58
Banco BTG Pactual SA UNT	1.578.224,58	274.549,43	235.789,76	2,51%	458.707,83	1.570,67	462.409,61
BBAS3	2.389.087,17	334.306,00	226.033,91	2,40%	713.601,91	2.435,59	714.188,80
BBDC3	1.327.035,60	165.651,85	123.155,40	1,31%	255.227,40	910,40	282.151,80
BBDC4	5.481.042,40	756.732,68	578.867,90	6,15%	1.138.409,99	4.034,13	1.239.837,05
BBSE3	787.132,08	80.616,11	13.200,38	0,14%	109.927,53	401,27	128.113,12
BEEF3	125.378,40	23.772,48	7.617,45	-0,08%	30.013,45	133,68	56.468,56
BIDI11	736.433,52	136.402,10	59.883,12	0,64%	235.457,30	796,94	231.297,82
BPAN4	179.151,28	28.341,30	23.171,30	0,25%	41.506,03	145,60	44.179,89
BRAP4	353.238,00	84.707,60	16.238,88	0,17%	61.084,42	261,37	103.973,41
BRFS3	959.311,55	193.549,13	32.831,35	0,35%	129.982,86	544,39	209.883,34
BRKM5	684.350,00	174.743,40	38.396,04	-0,41%	104.456,14	441,75	172.734,31
BRML3	408.385,01	73.119,69	57.524,00	0,61%	144.422,88	482,39	137.759,61
CASH3	79.803,17	20.238,59	14.394,35	0,15%	17.411,03	-	18.772,31
CCRO3	734.100,91	89.852,15	53.082,21	0,56%	171.067,77	599,76	181.856,12
CIEL3	134.903,04	12.354,03	7.308,84	0,08%	13.121,75	48,83	15.986,90
CMIG4	750.501,94	47.431,03	22.825,68	0,24%	55.186,17	207,64	68.984,20
CMIN3	413.856,30	44.721,74	27.025,34	0,29%	13.562,37	-	17.742,78
COGN3	239.362,20	41.594,55	28.039,61	0,30%	77.350,88	261,45	75.756,18
CPFE3	275.451,60	22.761,99	14.246,96	0,15%	32.926,93	121,29	39.182,75
CPL6	575.149,23	59.632,84	55.069,78	0,59%	80.507,70	293,84	93.795,35
CRFB3	350.730,70	34.755,57	26.140,74	0,28%	44.831,71	164,52	52.890,56
CSAN3	1.401.907,21	143.247,74	129.184,48	1,37%	238.683,13	859,57	269.682,95
CSNA3	852.295,34	152.078,69	110.751,24	1,18%	62.145,33	233,89	77.735,82
CVCB3	157.889,55	31.339,49	24.978,72	0,27%	55.218,40	184,72	52.847,82
CYRE3	249.935,40	44.856,40	39.948,35	0,42%	65.882,01	228,08	68.069,04
DXCO3	232.409,40	36.295,01	3.360,65	0,04%	25.640,38	-	30.808,71
ECOR3	136.097,75	22.698,12	16.059,34	0,17%	51.907,67	171,54	48.363,12
EGIE3	530.570,52	23.380,28	10.527,99	0,11%	45.588,86	170,54	56.224,58
ELET3	656.340,75	77.468,71	69.001,57	0,73%	143.295,94	505,51	154.477,20
ELET6	436.372,63	49.906,86	46.053,46	0,49%	84.418,15	300,98	93.220,89
ENBR3	255.321,24	19.003,22	4.588,11	0,05%	34.698,09	126,87	40.594,82
ENEV3	830.480,49	90.569,49	945,87	0,01%	79.913,72	297,52	97.471,51
ENG11	554.527,61	53.494,38	18.065,06	0,19%	66.951,28	246,48	79.571,67



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	112.761.090,15	VAR / PL:	8,343%
VAR:	9.407.607,15	ETL / PL:	10,4624%
ETL:	11.797.522,95	VAR / CDI:	24009,02%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	887,51	BAIXA 1:	1.009,14	Cenário 1:	16.665.973,00
					Cenário 2:	54.063,63
					Cenário 3:	-16.964.032,68

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
EQTL3	1.182.783,00	60.686,69	39.592,60	0,42%	89.731,88	337,25	- 111.881,71
EZTC3	112.557,70	18.609,60	15.091,34	0,16%	22.882,13	81,24	- 25.027,31
FLRY3	310.109,30	49.628,56	44.136,48	0,47%	88.754,52	304,45	- 89.829,97
GGBR4	1.594.263,72	166.362,50	50.989,29	0,54%	178.651,89	660,30	- 214.270,32
GNDI3	2.124.198,00	414.235,25	322.599,09	3,43%	734.550,44	2.460,95	- 705.392,29
GOAU4	421.681,68	37.009,56	16.021,05	0,17%	45.174,32	167,34	- 54.463,79
GOLL4	147.374,64	24.178,65	12.079,20	0,13%	18.075,15	66,49	- 21.439,48
HAPV3	837.496,00	188.006,71	144.241,88	1,53%	353.441,55	1.150,37	- 318.458,65
HYPE3	635.434,80	59.035,87	52.132,54	0,55%	93.565,45	340,39	- 108.200,58
IGTH1	173.549,72	32.804,54	18.182,90	0,19%	-	-	-
IRBR3	208.287,27	31.663,32	12.604,22	-0,13%	- 11.817,21	47,42	17.205,71
ITSA4	2.467.230,56	341.103,69	279.145,42	2,97%	407.184,15	1.469,75	- 462.477,88
ITUB4	6.126.080,01	1.176.586,95	876.387,67	9,32%	1.111.986,38	3.985,04	- 1.242.434,12
JBSS3	2.406.968,94	221.074,24	125.581,63	-1,33%	- 250.810,53	- 1.032,39	388.225,49
JHSF3	95.901,60	17.673,82	12.913,21	0,14%	27.609,93	94,64	- 27.901,77
KLBN11	1.044.102,94	113.753,67	41.636,78	-0,44%	- 74.471,48	301,17	110.449,69
LCAM3	428.135,82	66.920,01	36.058,85	0,38%	87.810,75	311,52	- 95.874,89
LREN3	1.421.969,10	330.397,36	218.316,40	2,32%	733.197,47	2.307,11	- 613.830,82
LWSA3	205.374,96	60.456,37	15.651,38	-0,17%	- 24.296,14	100,79	38.322,99
MGLU3	1.002.561,23	386.750,03	187.626,25	1,99%	126.594,48	464,89	- 149.591,96
MRFG3	406.801,68	43.570,15	1.307,51	-0,01%	- 8.925,69	35,18	12.450,89
MRVE3	201.876,51	30.444,64	25.889,81	0,28%	58.092,83	199,15	- 58.714,00
MULT3	300.226,05	50.249,12	33.902,97	0,36%	119.260,18	391,77	- 109.661,54
NTCO3	937.056,00	170.047,31	73.044,62	0,78%	18.077,11	69,81	- 24.017,86
PACUCAR_CBD ON ED	176.279,44	20.080,04	8.452,17	0,09%	19.720,94	72,90	- 23.657,41
PETR3	5.014.012,45	668.726,92	573.236,02	6,09%	1.127.940,46	3.967,96	- 1.208.284,18
PETR4	7.681.197,16	1.051.961,77	900.168,45	9,57%	1.963.701,16	6.820,42	- 2.043.830,43
PETZ3	265.555,96	54.943,97	43.013,54	0,46%	126.365,66	403,29	- 109.081,49
POSI3	36.652,50	8.389,04	1.143,35	-0,01%	- 791,37	3,12	1.103,45
PRI03	1.033.869,28	263.686,12	166.120,30	1,77%	353.420,13	1.185,88	- 340.551,59
QUAL3	255.666,09	36.398,24	30.472,29	0,32%	50.950,57	181,20	- 55.944,38
RADL3	1.256.581,20	183.020,50	54.938,91	-0,58%	- 55.442,55	221,05	79.464,97
RAIL3	990.752,40	115.370,65	12.767,56	-0,14%	24.963,61	96,12	- 32.942,58
RDOR3	1.278.965,26	151.906,78	118.011,69	1,25%	229.851,57	-	- 257.273,22
RENT3	1.759.674,40	277.091,73	151.241,45	1,61%	366.743,89	1.299,22	- 399.143,02
RRRP3	388.495,56	101.726,79	61.641,21	0,66%	30.865,37	115,81	- 38.334,36
SANB11	620.061,68	75.774,24	47.515,45	0,51%	98.391,09	356,14	- 112.469,19
SBSP3	642.911,00	109.644,04	21.674,52	-0,23%	- 38.349,59	154,14	56.041,46
SOMA3	359.665,72	71.183,57	55.104,32	0,59%	151.449,68	493,10	- 136.563,44
SULA11	378.028,35	41.974,81	8.419,21	-0,09%	18.922,23	71,99	- 24.276,02
SUZB3	2.229.146,30	197.696,70	25.750,03	-0,27%	- 76.296,81	302,64	108.031,69



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	112.761.090,15	VAR / PL:	8,343%
VAR:	9.407.607,15	ETL / PL:	10,4624%
ETL:	11.797.522,95	VAR / CDI:	24009,02%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	-	887,51	BAIXA 1:	1.009,14	Cenário 1:	16.665.973,00
					Cenário 2:	54.063,63
					Cenário 3:	-16.964.032,68

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
TAAE11	424.728,20	19.691,37	14.132,67	0,15%	19.316,03	73,65 -	24.908,87
TIMS3	543.774,39	53.602,32	11.654,48	-0,12%	35.150,93	132,81 -	44.370,93
TOTS3	747.170,88	94.478,30	28.530,87	0,30%	146.691,96	522,36 -	161.534,07
UGPA3	850.430,52	130.687,40	55.173,11	0,59%	151.595,33	544,04 -	169.926,40
USIM5	424.585,20	71.141,15	54.904,08	0,58%	53.451,79	196,32 -	63.186,89
VALE3	16.616.967,50	2.310.332,85	1.561.147,32	16,59%	625.351,94	2.393,45 -	813.597,44
VBBR3	1.327.438,72	153.184,40	119.940,07	1,27%	299.233,35	- -	320.406,48
VIIA3	377.212,37	54.193,25	34.414,77	0,37%	66.309,56	- -	74.510,09
VIVT3	1.097.522,46	91.002,65	45.433,12	-0,48%	28.778,21	110,76 -	37.931,76
WEGE3	2.428.226,28	278.946,27	89.800,69	0,95%	274.287,82	1.013,36 -	328.662,15
YDUQ3	334.856,86	57.469,86	37.134,53	0,39%	118.341,62	395,31 -	112.904,31
INDG22	-	186.481,78	186.095,33	1,98%	-	- -	-
COMPROMISSADA	2.588.635,49	121,24	52,89	0,00%	142,25 -	73,86 -	218,98
EMP AÇÃO PROVISÃO	29.644,97	173,08	17,16	0,00%	447,62 -	188,40 -	500,70
LFT	305.472,62	81,31	58,08	0,00%	0,00	- -	0,00
Total	112.571.449,89	16.210.665,79	9.407.607,15	100,00%	16.665.973,00	54.063,63	-16.964.032,68



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/01/2022

FIM EMB V A INVEST NO EXT CNPJ - 41252756000105

Dados Gerais

PL:	72.558.459,52	VAR / PL:	9,331%
VAR:	6.770.133,39	ETL / PL:	11,7009%
ETL:	8.490.023,32	VAR / CDI:	26851,20%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	8.493.257,30	BAIXA 1:	- 7.710.004,77	Cenário 1:	- 8.210.745,94
				Cenário 2:	- 609.556,62
				Cenário 3:	13.733.578,48

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	250.851,92	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	- 34.688,92	-	-	0,00%	-	-	-
EWJ_US	4.054.398,89	394.948,80	384.142,51	5,67%	- 513.866,52	- 36.489,59	819.858,04
SPY	12.738.688,30	1.891.884,78	1.875.884,11	27,71%	-2.056.187,04	- 120.098,07	3.442.668,06
VTV_US	7.901.878,65	1.142.656,91	623.081,71	-9,20%	- 122.755,94	- 71.116,91	169.923,47
COMPROMISSADA	159.764,74	7,48	5,57	0,00%	8,77	- 4,55	13,50
LFT	11.221,73	8,44	6,98	0,00%	0,00	-	0,00
AB AMERICAN GROWTH	8.408.872,64	1.771.926,59	1.727.832,81	25,52%	-1.729.938,32	- 75.679,85	3.090.370,36
FUNDSMITH EQ FUND	9.581.012,34	1.584.488,03	1.548.705,61	22,88%	-1.830.103,60	- 86.229,11	3.198.373,13
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.472.638,81	-	-	0,00%	-	-	-
LOOMIS US GROWTH	7.683.687,88	575.497,05	527.993,79	7,80%	- 447.299,54	- 69.153,19	652.473,43
MFS MERIDIAN EUROPEA	6.499.643,52	704.100,69	682.354,87	10,08%	- 922.828,30	- 58.496,79	1.503.503,17
PICTET GL FIC FIM IE	3.780.388,53	-	-	0,00%	-	-	-
WELLINGTON GLO QUAL	10.254.283,21	694.622,72	646.313,95	9,55%	- 587.775,44	- 92.288,55	856.422,32
Total	75.762.642,24	8.760.141,48	6.770.133,39	100,00%	-8.210.745,94	- 609.556,62	13.733.578,48



3. RISCO DE CRÉDITO

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

3.1. Relatório de Risco de Crédito



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Título	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB II	DE252	20/10/14	15/01/23	SABESP	750.736,95	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	DE252	21/10/14	15/01/23	SABESP	3.749.764,85	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	DE252	24/02/15	15/01/23	SABESP	1.924.776,24	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	LFSN	04/03/15	02/03/22	B VOTORA	25.436.191,15	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	25/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.149.613,98	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.149.015,65	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.264.075,02	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	01/06/15	15/04/23	RD COLIN	1.482.378,65	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	LFSN	09/06/15	07/06/22	B VOTORA	11.800.209,16	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB II	LFSN	30/06/15	28/06/22	B VOTORA	11.856.400,49	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	12/08/15	16/07/23	DUKE GEP	2.789.013,88	-	Aaa.br	-
FI RF EMB II	LFSN	06/11/15	04/11/22	BRABESCO	7.198.865,35	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	LFSN	18/11/15	16/11/22	BRABESCO	17.865.483,98	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	05/02/16	15/04/22	ECPT	17.452,18	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	05/02/16	15/07/22	ECPT	17.002,66	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	05/02/16	15/10/22	ECPT	16.556,42	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	05/02/16	15/01/23	ECPT	16.123,70	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	11/02/16	15/01/23	ECPT	56.285,15	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	16/02/16	15/07/22	ECPT	148.375,72	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	16/02/16	15/10/22	ECPT	144.663,90	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	16/02/16	15/04/22	ECPT	69.882,17	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	01/03/16	15/04/22	ECPT	82.198,15	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	01/03/16	15/01/23	ECPT	270.817,10	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	18/05/16	15/10/24	TRANS AL	1.689.648,60	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	623.556,61	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	374.133,97	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	20/06/16	15/10/24	TRANS AL	1.245.329,59	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	25/08/16	15/01/23	ECPT	142.312,96	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	25/08/16	15/01/23	ECPT	91.535,00	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	26/09/16	15/10/22	ECPT	387.813,19	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	10/10/16	15/01/23	SABESP	148.058,75	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.150.517,51	brAAA	-	-
FIM EMB II A	DE252	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.554.753,39	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	24/03/17	15/04/22	ECPT	293.008,92	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	24/03/17	15/07/22	ECPT	287.962,06	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	24/03/17	15/10/22	ECPT	282.935,42	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	24/03/17	15/01/23	ECPT	133.433,07	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	16/05/17	15/01/23	ECPT	251.286,40	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	16/05/17	15/07/22	ECPT	18.433,87	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	26/07/17	15/04/23	RD COLIN	2.726.717,47	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	DE252	25/08/17	15/08/24	PETR	16.892.109,75	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FIM EMB II A	DE252	22/09/17	15/09/22	ENERSUL	274.396,88	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	CRI	18/12/17	06/11/27	RB CAPIT	4.032.184,25	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	CRI	21/12/17	06/11/27	RB CAPIT	1.176.807,51	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	CRI	26/01/18	06/11/27	RB CAPIT	4.200.206,36	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	DE252	29/01/18	27/10/22	SUL AME	662.712,41	-	-	A+(bra)
FI RF EMB II	DE252	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.024.603,65	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.600.752,42	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	11.476.343,73	brAA	-	-
FI RF EMB II	DE252	23/05/18	15/05/28	COMGAS	25.869.883,15	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	564.393,25	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	564.393,25	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	564.393,25	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	564.393,25	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	564.393,25	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	11.512.925,93	-	A2.br	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Título	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	13.256.553,70	brA	Aa1.br	-
FI RF EMB II	DE252	26/07/18	15/07/25	CSMG	14.372.124,57	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	07/08/18	15/02/22	CEMIG G	1.627.203,18	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	07/08/18	15/02/22	CEMIG G	78.714,82	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	07/08/18	15/02/22	CEMIG G	552.294,18	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	852.757,17	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	483.997,31	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	1.279.135,75	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	07/08/18	15/02/25	CEMIG	2.494.645,42	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB II A	LFSC	14/11/18	15/03/24	BRADESCO	312.122,94	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	DE252	04/01/19	07/06/24	MOV_PART	1.166.517,38	-	-	AA-(bra)
FIM EMB II A	LFSC	17/01/19	16/09/24	ITAUUBB	300.583,64	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	LFSC	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	2.441.795,93	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	LFSC	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	2.441.795,93	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	DE252	19/08/20	14/08/24	B3SA	1.722.472,75	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	531.901,25	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	3.367.855,54	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	1.917.913,17	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	5.798.490,85	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	655.884,86	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	5.306.704,81	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	7.870.618,37	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	810.912,20	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	581.766,99	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	30/09/20	22/09/25	BCBF	264.221,80	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	DE252	08/01/21	15/04/24	ECORODOV	1.350.544,48	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	DE252	20/01/21	15/07/23	AEGEA SA	569.319,24	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	DE252	20/01/21	23/07/23	COPEL GT	175.932,51	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	DE252	04/02/21	15/07/23	AEGEA SA	192.445,94	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	DE252	05/02/21	23/07/23	COPEL GT	110.570,06	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	DE252	05/02/21	15/07/23	AEGEA SA	264.613,17	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	DE252	05/02/21	15/07/24	COPEL GT	283.929,97	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	LFS	12/02/21	22/08/22	ITAU	5.158.504,09	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	5.618.599,63	brAA	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	5.633.351,66	brAA	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.823.620,99	brAAA	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	548.020,19	brAA+	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	5.447.594,19	brAA+	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	15/05/29	ELETROB	1.583.344,89	brAAA	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.034.701,66	brAAA	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.246.827,74	brAAA	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	15/07/34	IGUA SAN	2.461.279,18	brAA	-	-
FI RF EMB II	DE252	12/02/21	15/05/28	COMGAS	22.531.833,71	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	LFS	12/02/21	07/11/22	ITAU	9.708.138,85	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	LFS	12/02/21	07/11/22	ITAU	813.834,77	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	LFS	12/02/21	07/11/22	ITAU	813.834,77	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	LFS	12/02/21	07/11/22	ITAU	6.510.678,14	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	LFS	12/02/21	07/11/22	ITAU	4.069.173,84	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	LFS	12/02/21	07/11/22	ITAU	5.696.843,37	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	645.353,25	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	161.338,31	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	1.151.955,55	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	16/07/23	DUKE GEP	11.266.825,54	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	639.511,90	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	163.919,73	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.125.540,94	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	1.174.542,92	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.279.023,80	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	639.511,90	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/22	ECPT	172.987,15	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/07/22	ECPT	138.250,98	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	782.762,56	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	LFS	14/05/21	14/11/22	ITAU	8.147.148,54	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	1.745.252,08	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	582.169,78	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/05/22	SUL AME	1.643.676,90	-	-	A+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	727.914,82	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	656.142,23	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.903.700,86	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	LFSN	14/05/21	27/01/25	BRADESCO	11.542.210,31	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/11/24	CCR	5.714.150,70	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/11/24	ECORODOV	3.808.419,32	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/02/25	SABESP	1.315.348,15	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/05/28	COMGAS	10.014.148,32	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	14/05/21	15/06/27	JAGUARA	1.791.817,13	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	14/05/21	15/06/27	ENERGMIR	1.095.698,40	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	LFSN	14/05/21	01/08/25	BRADESCO	3.761.364,17	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	LF252	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	1.009.112,91	-	Aa1.br	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Título	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.154.356,03	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	641.779,59	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	490.336,55	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.313.212,37	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/09/34	BRKA	3.281.292,97	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/10/30	LAME	2.013.229,07	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/10/38	TAUBATE	8.834.812,24	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	28/05/21	15/12/26	IRB	2.416.118,18	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/10/30	LAME	959.823,15	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.619.166,83	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/03/29	ANET	1.744.641,12	brA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/03/28	BRISANET	3.249.983,47	brA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/10/36	PAMPASUL	1.000.867,26	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	28/05/21	15/05/23	LIGHT	853.442,97	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	28/05/21	15/05/23	LIGHT	1.910.086,65	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	28/05/21	15/05/23	LIGHT	1.202.948,19	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	28/05/21	15/05/23	LIGHT	877.827,06	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/10/30	LAME	449.917,10	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.392.968,90	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	28/05/21	15/03/31	LOCALIZA	8.048.097,00	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/05/30	NORTE EN	1.265.973,87	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.561.028,25	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/06/21	15/11/25	QUATA	4.350.261,47	-	-	A-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	10/06/21	15/12/35	MS 306	2.125.679,27	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	31.289,07	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	25/11/24	DASA	428.261,34	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	844.804,94	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	04/11/25	BCBF	508.282,54	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	04/11/25	BCBF	508.282,54	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	498.531,27	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	1.013.274,95	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	998.075,82	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	25/11/24	DASA	1.739.368,77	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	25/11/24	DASA	434.335,97	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	211.201,23	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	528.561,82	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	04/11/25	BCBF	1.523.801,77	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LFSC	14/06/21	19/06/24	BNBMM	567.958,20	brAAA	AAbr	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LFSC	14/06/21	12/06/24	BNBMM	859.665,33	brAAA	AAbr	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/06/21	29/06/24	SBF COME	728.759,43	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/06/21	29/06/24	SBF COME	1.744.916,96	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/06/21	15/09/25	BRKA	1.907.421,92	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/06/21	15/09/25	BRKA	634.016,30	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/06/21	25/04/23	CELPA	2.562.516,85	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	15/06/21	15/12/30	B2W	465.853,02	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	15/06/21	15/09/34	BRKA	972.991,53	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	15/06/21	15/10/36	PAMPASUL	2.441.552,84	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	16/06/21	13/07/23	ECORODOV	2.039.409,34	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	16/06/21	15/05/23	LIGHT	2.113.287,36	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	16/06/21	15/03/29	OMEGA GE	2.050.997,69	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	16/06/21	20/04/26	SMARTIFI	2.083.159,75	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	16/06/21	30/09/23	USIMINAS	2.071.161,50	brAA+	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	16/06/21	30/09/23	USIMINAS	517.790,37	brAA+	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	17/06/21	15/02/31	CORSAN	746.793,73	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	17/06/21	15/02/26	CORSAN	1.054.931,60	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	18/06/21	15/12/30	MG050	499.518,26	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	21/06/21	15/04/28	PAMPASUL	1.276.075,44	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	25/06/21	27/11/25	GUAR	1.239.089,36	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/06/21	15/10/30	LAME	293.945,84	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/06/21	15/12/35	MS 306	1.555.682,31	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/06/21	15/10/30	LAME	1.523.719,26	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/06/21	15/12/35	MS 306	85.027,17	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.429.537,20	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/06/21	15/09/34	BRKA	1.644.947,00	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	30/06/21	27/11/25	GUAR	1.353.627,03	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	30/06/21	15/12/35	MS 306	3.149.154,48	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	01/07/21	15/10/26	LIGHT	5.119.149,39	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	01/07/21	15/12/35	MS 306	2.754.460,45	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	02/07/21	18/02/25	RENNER	1.149.633,69	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	02/07/21	18/02/25	RENNER	243.131,28	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	07/07/21	15/03/29	CAGECE	1.141.544,52	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	07/07/21	15/07/28	VENSJOR	317.664,39	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	07/07/21	15/07/28	VENSJOR	1.532.561,72	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	08/07/21	15/06/31	VAMOS	254.188,77	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	08/07/21	15/06/31	VAMOS	253.482,81	brAA+	-	AA-(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Título	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	08/07/21	15/03/29	CAGECE	2.601.635,33	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.029.420,87	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LFS	12/07/21	31/10/22	ITAU	1.352.499,01	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LFSN	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	3.171.204,76	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	13/07/21	15/07/29	GUARIROB	1.181.960,61	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	13/07/21	15/12/26	IRB	1.897.758,90	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	214.985,57	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	13/07/21	15/12/26	IRB	921.768,61	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	15/12/30	B2W	1.677.529,83	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	15/09/34	BRKA	445.103,31	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	13/07/21	15/12/26	IRB	479.319,68	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	15/12/30	B2W	1.480.173,38	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	15/12/30	B2W	2.170.920,95	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	15/12/30	B2W	1.085.460,48	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	15/09/34	BRKA	742.913,97	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	1.808.844,13	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	282.764,28	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	13/07/21	15/12/26	IRB	3.795.517,79	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	15/03/29	ANET	1.063.157,30	brA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	11/03/25	BRML	3.123.006,66	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	10/05/24	MULTIPLA	3.088.293,31	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	376.749,12	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	376.749,12	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	1.343.192,52	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	15/07/27	RT BANDE	2.340.214,63	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	15/05/23	ELEKTRO	553.096,33	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	15/09/23	SONAE	3.089.982,44	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	16/07/21	15/02/31	CORSAN	2.752.764,68	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	19/07/21	15/07/30	PARANAGU	688.719,00	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	19/07/21	15/05/30	NORTE EN	1.787.531,77	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	19/07/21	15/10/30	LAME	1.941.242,33	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	1.933.606,18	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	708.534,74	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	DE252	21/07/21	15/05/25	INTERVIA	1.276.948,97	-	Aa2.br	-
FIM EMB I A	DE252	21/07/21	05/03/24	ENERG TR	1.317.961,67	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	DE252	21/07/21	15/01/26	AERIS	1.177.062,27	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	21/07/21	15/07/27	RT BANDE	1.124.993,37	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	DE252	21/07/21	15/03/29	OMEGA GE	1.036.779,33	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	21/07/21	20/08/26	VAMOS	1.060.666,06	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	23/07/21	15/12/30	MG050	1.498.554,78	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	26/07/21	15/03/29	ANET	2.657.893,24	brA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	545.772,27	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.396.661,31	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	1.478.377,76	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	3.755.637,38	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	29/07/21	15/10/24	BKBR	1.410.989,92	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	29/07/21	15/12/26	RD COLIN	2.101.130,74	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	30/07/21	15/05/30	NORTE EN	991.776,77	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	02/08/21	15/01/31	ECHOENER	1.615.235,36	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	995.446,66	brAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	04/08/21	15/04/27	MOV_PART	1.042.450,19	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	05/08/21	15/06/32	ENSINOP	680.752,82	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	06/08/21	15/12/31	METRORIO	1.040.510,46	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LF252	10/08/21	10/08/23	PARANA B	521.774,66	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.053.493,04	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	11/08/21	15/06/27	AUTOPIST	1.420.135,31	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	11/08/21	15/08/31	CSAN	5.023.580,78	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LF252	12/08/21	14/08/23	ABC	1.042.184,12	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	17/08/21	15/05/30	NORTE EN	3.008.000,59	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	18/08/21	15/12/31	METRORIO	1.055.213,33	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	18/08/21	15/12/31	METRORIO	818.836,50	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	20/08/21	15/05/44	CTEEP	897.640,39	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/08/21	15/08/29	CEEE D	3.907.877,40	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.039.367,73	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	06/09/21	15/08/31	COMGAS	3.137.181,71	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	08/09/21	15/05/30	NORTE EN	488.887,61	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	653.875,86	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	58.556,05	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	292.780,24	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	16/09/21	15/06/24	PROLAGOS	2.202.250,33	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	16/09/21	15/04/26	ELETROB	2.011.094,74	brAAA	-	-
FIM EMB I A	DE252	16/09/21	21/10/26	AUTOBAN	910.549,28	brAAA	-	-
FIM EMB I A	DE252	17/09/21	01/10/24	EQUATENE	1.435.428,63	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	17/09/21	15/03/28	BRISANET	1.425.149,36	brA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.074.486,27	brAA+	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Título	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.592.452,67	brAAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	20/09/21	15/12/30	MG050	999.036,52	brAAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	20/09/21	15/12/30	MG050	999.036,52	brAAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.053.142,03	brAAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/09/21	15/07/39	EDPM	1.968.260,43	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/09/21	15/02/31	CORSAN	767.538,00	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/09/21	15/02/31	CORSAN	767.538,00	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/09/21	15/02/31	CORSAN	255.154,53	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/09/21	15/02/31	CORSAN	255.154,53	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	713.219,72	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	713.219,72	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	916.493,21	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	356.022,36	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	356.022,36	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.977.482,75	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	5.038.615,09	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	LF252	23/09/21	14/08/23	ABC	1.042.184,12	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	24/09/21	15/03/24	CCPR	2.068.264,21	-	A.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	24/09/21	20/05/25	CEA MODA	2.048.551,00	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LF252	24/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.034.375,05	brAAA	AAAbr	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	27/09/21	28/05/23	IGUATEMI	2.329.593,81	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	27/09/21	15/01/26	LOCAMERI	1.828.825,96	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	27/09/21	05/03/24	ENERG TR	2.063.485,87	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LF252	27/09/21	10/08/23	PARANA B	1.043.549,32	brAAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LF252	27/09/21	01/04/24	CNH	1.916.082,28	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	793.184,94	brAAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	30/09/21	15/01/31	SIMPAR	1.008.976,70	brAAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	1.765.659,61	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	1.814.033,84	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	04/10/21	15/12/31	METRORIO	558.708,88	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.298.989,98	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	19/10/21	15/06/30	ECHOENER	1.093.904,61	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	LF252	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.109.304,36	brAAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	LF252	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.181.388,71	brAAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/10/21	15/12/35	CART	2.644.523,18	brAAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	22/10/21	15/12/35	CART	1.586.713,91	brAAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	25/10/21	15/03/26	VIX LOGI	1.027.348,47	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	27/10/21	15/06/39	ANEMUS	248.175,97	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	27/10/21	15/06/39	ANEMUS	251.399,04	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	27/10/21	15/06/39	ANEMUS	268.588,71	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	27/10/21	15/06/39	ANEMUS	248.175,97	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.275.420,22	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	785.384,08	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	6.241.462,90	brAAA	-	-
FIM EMB I A	LFV	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.254.019,15	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	29/10/21	15/06/39	ANEMUS	1.074.354,85	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	29/10/21	15/10/31	ENERGISA	2.926.077,47	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	29/10/21	15/10/31	CELP	2.074.926,55	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	29/10/21	15/10/31	ELEKTRO	2.074.358,34	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	29/10/21	15/10/31	COELBA	2.074.631,03	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	03/11/21	15/06/32	ENSINOP	1.504.463,73	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	04/11/21	15/07/39	UTE GNA	2.978.501,82	brAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/11/21	15/10/28	LIGHT	1.536.669,77	brAAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.032.505,72	brAAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	3.956.710,54	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/11/21	15/06/39	ANEMUS	5.098.888,14	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	26/11/21	15/07/29	GUARIROB	2.015.664,97	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	26/11/21	15/04/26	ECORODOV	2.030.384,96	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	30/11/21	15/06/39	ANEMUS	2.090.694,55	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	30/11/21	15/03/28	BRISANET	812.227,98	brA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	CRF	03/12/21	15/12/36	REIT SEC	2.320.800,73	-	-	AAAsf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LFSC	03/12/21	11/06/24	BNBM	567.435,86	brAAA	AAbr	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	06/12/21	15/12/35	TESC	8.327.078,27	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/12/21	15/11/25	QUATA	2.496.990,53	-	-	A-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/12/21	15/07/39	EDPM	3.425.519,29	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/12/21	15/03/29	ANET	987.673,13	brA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	20/12/21	15/11/35	HAZTEC	2.023.591,63	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	06/01/22	15/09/41	TUCANOHO	1.511.694,87	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	06/01/22	15/09/41	TUCANOHO	299.315,58	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/01/22	15/03/26	VIX LOGI	1.008.459,53	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	13/01/22	15/07/30	PARANAGU	1.394.630,70	brAA	-	-
FIM EMB I A	LF252	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.005.812,59	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/01/22	15/07/34	RT BANDE	333.669,18	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/01/22	15/07/34	RT BANDE	5.588.186,44	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	FIDC	-	-	FIDC VERDECARD SN3	4.581.778,50	brAAA(sf)	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Título	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	FIDC	-	-	SANEAGOIFR IV 1 FIDC	2.360.464,90	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	FIDC	-	-	FIDC CELG DIST SN B	3.136.374,15	-	-	AA-sf(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	FIDC	-	-	FIDC CREDZ SN4	13.883,03	-	-	AAAsf(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	FIDC	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.513.185,67	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	FIDC	-	-	FIDC VERDECARD SN5	700.000,00	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	FIDC	-	-	FIDC VERDECARD SN6	1.400.000,00	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	FIDC	-	-	SN3	755.609,36	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	FIDC	-	-	FARM SYN AGRO FIDC	3.263.153,07	-	-	AAAsf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	FIDC	-	-	BR ELETRO FIDC S1	4.657.277,35	-	-	Aasf(bra)

Observação: Em janeiro de 2022, nenhum dos ativos da carteira de crédito da EMBRAER PREV sofreu rebaixamento de suas classificações de risco e ficou abaixo do mínimo estabelecido na escala da Política de Investimentos de 2022.



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 **3.897.633.521,54**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.929.215.682,31	3.897.633.521,54	75,15%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	2.117.700.476,78	3.897.633.521,54	54,33%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	811.515.205,53	3.118.106.863,70	20,82%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	779.526.715,92	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	389.763.357,96	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	974.408.380,39	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	974.408.380,39	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	716.269.227,61	2.728.343.418,61	18,38%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	974.408.380,39	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	101.513.338,86	779.526.715,92	2,60%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	31.786.882,37	584.645.051,46	0,82%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	779.526.715,92	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	117.168.555,12	389.763.357,96	3,01%	Enquadrado

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

6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE JANEIRO DE 2022 À 31 DE JANEIRO DE 2022



Bradesco

FIM EMB I A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FUNTE ANBIMA			DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
14/01/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2023	Compra	0,0429%	0,0558%	0,0006%	0,1350%	-0,0129%	NÃO
18/01/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2023	Compra	0,0403%	0,0346%	-0,0164%	0,1042%	0,0057%	NÃO
19/01/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,7595%	5,7041%	5,6056%	5,9366%	0,0554%	NÃO
20/01/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	BTG PACT	LFT	01/03/2022	Compra	-0,2886%	0,0329%	-0,0466%	0,0690%	-0,3215%	SIM
20/01/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6995%	5,6600%	5,5363%	5,8670%	0,0395%	NÃO

FIM EMB II A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FUNTE ANBIMA			DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
14/01/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,4439%	5,4439%	5,1884%	5,7394%	0,0151%	NÃO
14/01/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,3910%	5,3700%	5,1200%	5,6326%	0,0210%	NÃO
14/01/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,5190%	5,4744%	5,2893%	5,7368%	0,0446%	NÃO
17/01/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,4390%	5,5751%	5,1756%	5,7266%	-0,1361%	NÃO
17/01/2022	FIM EMB II A	BNP	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,4490%	5,5751%	5,1756%	5,7266%	-0,1261%	NÃO
17/01/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,3610%	5,4740%	5,1043%	5,6169%	-0,1130%	NÃO
17/01/2022	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,3710%	5,4740%	5,1043%	5,6169%	-0,1030%	NÃO
17/01/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,4690%	5,5679%	5,2436%	5,6912%	-0,0989%	NÃO
25/01/2022	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/05/2045	Compra	5,6618%	5,6866%	5,5029%	5,8406%	-0,0248%	NÃO
25/01/2022	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,6635%	5,6868%	5,5062%	5,8364%	-0,0233%	NÃO

FIM EMB VI A CRED PRIV

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FUNTE ANBIMA			DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
05/01/2022	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,5090%	5,5576%	5,3398%	5,6698%	-0,0486%	NÃO
06/01/2022	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	ATIVA	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,5190%	5,6129%	5,3899%	5,7203%	-0,0939%	NÃO
11/01/2022	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,4218%	5,4906%	5,1562%	5,6684%	-0,0688%	NÃO
12/01/2022	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/08/2022	Venda	5,5006%	5,5808%	4,8484%	5,9364%	-0,0802%	NÃO
12/01/2022	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/08/2022	Venda	5,5006%	5,5808%	4,8484%	5,9364%	-0,0802%	NÃO



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2022 À 31 DE JANEIRO DE 2022



Bradesco

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	14,61	9.500,00	138.765,17	14,45	14,61	14,81	60.365,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	BBD4C	22,70	300,00	6.810,00	22,37	22,75	23,00	61.604,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	BBRK3	1,30	900,00	1.168,00	1,23	1,31	1,40	1.639,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	BBS5E3	23,00	200,00	4.599,57	22,59	23,02	23,25	17.823,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	BIDI11	25,36	400,00	10.144,28	24,41	25,40	26,08	38.256,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	BMGB4	3,14	400,00	1.256,90	3,11	3,14	3,19	2.546,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	23,79	900,00	21.408,44	23,35	23,81	24,40	18.871,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,49	2.600,00	24.671,01	9,39	9,53	9,63	15.717,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	BRPR3	7,20	500,00	3.602,21	7,13	7,21	7,31	3.231,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	23,08	900,00	20.772,60	22,68	23,11	23,42	8.949,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	CPFE3	28,81	400,00	11.523,41	28,25	28,80	29,09	8.840,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	CRFB3	16,61	1.500,00	24.908,32	16,31	16,63	16,75	6.879,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	17,29	600,00	10.374,62	17,04	17,33	17,61	15.312,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,96	100,00	3.496,18	34,65	35,05	35,65	16.025,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	34,41	400,00	13.763,42	33,92	34,43	34,83	10.136,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	13,19	900,00	11.870,70	12,43	13,08	13,42	25.330,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,80	3.700,00	47.363,14	12,43	13,08	13,42	25.330,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,98	4.100,00	53.216,07	12,43	13,08	13,42	25.330,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	3,09	600,00	1.852,50	2,90	3,07	3,17	3.730,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	22,95	1.500,00	34.420,13	22,42	22,94	23,18	18.918,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	GNDI3	70,73	100,00	7.073,49	69,22	70,53	71,65	29.899,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Venda	GOAU4	11,62	3.700,00	43.006,88	11,53	11,63	11,76	10.703,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	12,71	3.500,00	44.467,77	12,30	12,55	12,74	45.443,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	HBSA3	3,04	1.100,00	3.339,14	2,89	3,06	3,17	5.781,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	30,95	1.600,00	49.518,15	29,78	30,82	31,25	21.227,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	30,95	2.700,00	83.572,03	29,78	30,82	31,25	21.227,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,79	300,00	5.937,23	19,61	19,86	20,00	5.945,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,14	2.200,00	22.299,42	10,00	10,16	10,26	23.095,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	25,08	500,00	12.537,50	24,52	25,13	25,51	57.413,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	LCAM3	25,88	400,00	10.352,83	25,34	26,02	26,27	9.303,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	28,11	700,00	19.675,64	27,82	28,11	28,47	31.244,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	9,60	100,00	960,13	9,13	9,56	9,81	21.892,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	MATD3	15,45	100,00	1.544,80	14,70	15,57	15,94	3.138,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Venda	MEGA3	11,44	200,00	2.287,00	11,22	11,47	11,73	5.845,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	MRVE3	13,38	100,00	1.338,00	13,12	13,35	13,51	12.283,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,55	100,00	2.154,80	21,23	21,53	21,75	14.953,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	22,62	1.300,00	29.403,17	21,21	22,47	22,95	31.332,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	PARD3	22,79	200,00	4.558,00	22,06	22,69	23,09	2.148,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	32,35	800,00	25.882,04	32,07	32,42	33,00	108.580,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	23,61	500,00	11.802,82	23,38	23,68	24,02	36.050,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	15,64	1.200,00	18.766,71	15,41	15,63	15,95	24.554,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,27	600,00	12.163,77	19,79	20,27	20,56	3.038,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	58,65	2.000,00	117.295,60	57,26	58,57	59,10	29.764,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	SEER3	11,46	800,00	9.164,85	11,25	11,44	11,60	3.149,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	SEER3	11,48	500,00	5.739,55	11,25	11,44	11,60	3.149,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	14,32	5.700,00	81.596,38	14,11	14,38	14,64	12.492,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	25,37	500,00	12.684,13	25,16	25,35	25,75	11.955,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	59,04	1.000,00	59.041,83	58,53	59,36	60,46	22.607,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	15,91	800,00	12.726,77	15,22	15,88	16,08	5.660,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	81,56	100,00	8.156,32	80,87	81,45	82,94	81.046,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	22,65	3.100,00	70.210,48	22,32	22,73	22,94	19.491,00
31-01-22	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	21,74	500,00	10.868,00	21,46	21,88	22,11	7.116,00
31-01-22	FIA RVA EMB IV	Venda	INTB3	31,09	1.319,00	41.006,43	30,26	30,97	31,36	6.413,00



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.