



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Julho/2021





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: 30/07/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.691.923.548,47	VAR / PL:	2,366%
VAR:	87.339.052,36	ETL / PL:	2,9667%
ETL:	109.526.732,79	VAR / CDI:	14659,96%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(283.740.111,72)	BAIXA 1:	246.909.468,03	Cenário 1:	354.762.416,38
				Cenário 2:	(73.466.786,25)
				Cenário 3:	(444.274.681,21)

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	106.699,26	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(876.904,62)	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	26.323.756,65	4.323.538,06	3.634.324,55	4,16%	12.728.560,99	40.510,45	(10.922.012,10)
ALSO3	1.749.895,00	261.953,59	215.831,80	0,25%	962.726,74	2.993,15	(785.380,96)
AMER3	6.831.162,83	1.868.925,58	916.937,45	1,05%	-	-	-
ANIM3	471.343,44	102.736,46	50.985,64	0,06%	6.157,19	23,85	(8.239,95)
ASAI3	8.935.994,40	658.647,85	222.082,58	0,25%	-	-	-
AZUL4	718.327,00	162.592,55	121.745,75	0,14%	557.048,72	1.609,49	(389.076,07)
B3SA3	30.735.572,79	1.741.085,03	(186.321,98)	-0,21%	3.052.719,14	11.348,99	(3.711.133,44)
Banco BTG Pactual SA UNT	23.147.370,40	2.072.571,08	1.353.207,20	1,55%	(2.679.489,55)	(11.099,50)	4.211.992,11
BBAS3	14.477.098,00	2.262.383,17	1.909.525,38	2,19%	7.317.330,86	23.107,76	(6.173.733,03)
BBDC3	1.444.264,20	203.706,69	173.553,35	0,20%	816.925,65	2.526,39	(658.880,11)
BBDC4	38.247.899,27	6.107.302,20	5.039.009,11	5,77%	22.550.988,85	69.174,90	(17.873.844,26)
BBRK3	26.680,00	10.558,56	(2.522,69)	0,00%	(14.075,65)	(77,88)	47.234,91
BBSE3	1.189.650,00	150.690,91	103.589,74	0,12%	673.771,42	2.083,16	(543.131,65)
BEEF3	122.760,00	8.242,50	5.370,82	0,01%	33.458,08	115,41	(34.286,15)
BIDH1	9.870.568,00	1.558.753,53	(652.542,34)	-0,75%	(5.530.357,38)	(31.567,51)	20.276.137,87
BIDI4	6.668,62	1.033,15	(364,11)	0,00%	(3.571,07)	(19,91)	12.236,20
BKBR3	208.240,00	33.176,01	18.414,10	0,02%	23.585,32	87,12	(28.251,84)
BLCP11	1.526.877,30	-	-	0,00%	-	-	-
BMGB4	177.080,00	16.489,76	12.047,32	0,01%	63.646,11	212,11	(60.411,03)
BMLC11	1.740.481,50	-	-	0,00%	-	-	-
BPAN4	2.652.804,00	971.323,51	747.450,80	0,86%	776.314,93	2.656,07	(781.179,73)
BPML11	1.345.171,50	78.867,16	(25.860,52)	-0,03%	(26.183,88)	(103,08)	36.416,31
BRAP4	5.707.520,00	623.860,24	(322.487,17)	-0,37%	(2.173.701,43)	(10.657,60)	5.241.482,00
BRDT3	4.937.243,85	340.389,16	193.911,76	0,22%	(1.153.026,34)	(5.116,86)	2.149.535,89
BRFS3	1.154.901,00	261.273,81	187.812,22	0,22%	580.470,90	1.834,93	(490.811,72)
BRIT3	186.528,00	-	-	0,00%	-	-	-
BRKM5	860.720,00	106.678,52	67.937,77	0,08%	(187.288,53)	(823,03)	340.652,54
BRML3	5.103.907,20	758.262,21	626.968,57	0,72%	3.007.375,51	9.226,24	(2.384.274,29)
BTLG11	989.232,24	52.750,32	(12.603,95)	-0,01%	(17.355,94)	(68,26)	24.082,80
CASH3	249.900,00	53.805,57	(39.714,77)	-0,05%	(206.636,84)	-	2.458.849,72
CBAV3	128.136,00	3.157,89	(88,86)	0,00%	-	-	-
CBOP11	35.768,40	1.560,49	871,24	0,00%	3.133,49	11,71	(3.857,52)
CCRO3	6.672.545,00	473.797,72	348.662,64	0,40%	495.026,70	1.861,96	(618.352,77)
CEAB3	12.623,84	3.125,58	2.298,12	0,00%	8.793,82	26,04	(6.469,03)
CEOC11	561.176,21	19.421,01	(12.562,49)	-0,01%	(20.127,50)	(79,91)	28.556,62
CESP6	10.731.960,84	325.179,27	(212.545,78)	-0,24%	400.137,01	1.531,73	(520.793,54)
CIEL3	3.809.111,00	672.572,31	576.588,57	0,66%	3.179.217,62	9.022,58	(2.139.227,24)
CJCT11	2.346.271,35	57.708,62	(16.601,22)	-0,02%	80.934,49	310,24	(105.673,73)
CLSA3	700.275,00	-	-	0,00%	-	-	-



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.691.923.548,47	VAR / PL:	2,366%
VAR:	87.339.052,36	ETL / PL:	2,9667%
ETL:	109.526.732,79	VAR / CDI:	14659,96%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(283.740.111,72)	BAIXA 1:	246.909.468,03	Cenário 1:	354.762.416,38
				Cenário 2:	(73.466.786,25)
				Cenário 3:	(444.274.681,21)

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
CMIG4	713.766,90	134.858,31	110.263,44	0,13%	475.655,91	1.422,46	(357.168,00)
CNES11	613.582,20	19.420,13	14.869,85	0,02%	126.766,95	449,43	(138.207,84)
CNRD11	87.218,50	-	-	0,00%	-	-	-
COGN3	1.095.425,73	255.840,00	183.015,09	0,21%	839.625,90	2.432,68	(589.850,32)
CPFE3	8.160.845,00	736.782,97	608.887,18	0,70%	4.391.142,13	13.709,42	(3.614.610,81)
CPL66	193.131,00	13.250,96	5.470,70	0,01%	37.006,41	132,04	(40.938,97)
CRFB3	1.608.464,00	181.193,53	155.622,87	0,18%	807.719,73	2.553,69	(683.193,71)
CSAN3	2.184.770,00	194.411,34	29.645,68	0,03%	(303.429,17)	(1.273,24)	492.241,46
CSED3	5.382.480,00	1.229.904,13	521.316,14	0,60%	-	-	-
CSNA3	14.775.910,00	2.060.971,27	(57.797,23)	-0,07%	(1.952.814,63)	(8.163,44)	3.138.805,22
CURY3	60.515,00	7.057,64	2.141,26	0,00%	5.134,38	19,22	(6.339,61)
CVCB3	282.777,00	81.353,47	51.525,97	0,06%	125.403,26	404,94	(111.055,44)
CYRE COM-CPP ON	229.320,00	25.512,15	20.826,49	0,02%	103.443,13	333,10	(91.053,45)
CYRE3	326.196,00	30.836,75	26.797,60	0,03%	163.792,92	517,86	(138.545,02)
ECOR3	204.660,00	27.871,03	23.994,86	0,03%	126.493,88	384,34	(98.239,00)
EGIE3	531.953,00	23.887,16	19.775,08	0,02%	111.052,04	393,35	(120.822,20)
ELET3	3.269.143,87	587.235,42	484.310,51	0,55%	1.020.326,84	3.463,90	(1.009.056,79)
ELET6	8.525.492,01	1.513.568,86	1.234.459,86	1,41%	2.966.951,92	9.931,60	(2.843.771,67)
ENBR3	221.107,00	12.314,70	9.405,97	0,01%	69.172,29	234,76	(68.363,69)
ENEV3	1.400.235,00	129.258,70	78.603,01	0,09%	169.989,16	625,63	(201.892,03)
ENGI11	1.233.203,52	137.878,96	113.471,38	0,13%	468.261,79	1.548,49	(436.903,86)
ENJU3	28.872,00	5.879,53	1.964,52	0,00%	21.114,69	-	(15.177,51)
EQTL3	13.115.901,92	985.494,10	658.937,80	0,75%	1.617.276,16	5.947,08	(1.916.982,86)
ESPA3	1.439.240,40	178.875,40	71.119,48	0,08%	-	-	-
EUCATEX PN	79.800,00	16.509,63	10.349,97	0,01%	44.567,68	138,17	(36.134,67)
EWJ_US	3.014.725,52	257.975,50	(174.698,70)	-0,20%	(371.281,37)	(27.132,53)	589.488,06
EZTC3	146.848,00	22.130,91	16.820,46	0,02%	116.719,25	335,25	(80.523,21)
FLRY3	399.396,00	38.967,02	32.158,69	0,04%	177.393,47	572,68	(157.011,44)
GGBR4	1.705.020,00	223.247,26	54.546,36	0,06%	381.739,82	1.343,52	(409.346,35)
GGPS3	2.184.224,90	514.224,12	(192.793,99)	-0,22%	-	-	-
GMAT3	3.713.922,65	205.199,42	166.941,79	0,19%	828.667,25	2.917,40	(889.244,00)
GNDI3	14.742.819,00	1.079.983,58	693.155,09	0,79%	2.937.300,29	10.446,42	(3.225.349,24)
GOAU4	551.502,00	59.164,28	13.537,92	0,02%	58.570,66	217,06	(70.684,27)
GOLL4	3.795.846,40	808.052,00	639.046,32	0,73%	4.279.267,85	11.187,69	(2.435.006,14)
HAPV3	21.004.510,82	1.756.965,04	1.134.808,30	1,30%	4.816.365,21	16.912,54	(5.138.203,28)
HBRH11	1.373.149,33	-	-	0,00%	-	-	-
HBSA3	407.925,00	52.928,87	11.222,61	0,01%	22.687,54	86,09	(28.926,43)
HGTX3	524.025,00	116.383,52	79.189,32	0,09%	(193.718,88)	(942,03)	457.097,96
HSML11	7.991.602,00	417.344,46	302.974,66	0,35%	1.340.840,77	4.834,01	(1.518.739,32)
HYPE3	7.511.232,00	619.660,97	336.945,21	0,39%	1.395.776,21	4.992,74	(1.552.901,91)
IFCM3	4.440.000,00	1.510.970,08	(755.562,98)	-0,87%	-	-	-



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.691.923.548,47	VAR / PL:	2,366%
VAR:	87.339.052,36	ETL / PL:	2,9667%
ETL:	109.526.732,79	VAR / CDI:	14659,96%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(283.740.111,72)	BAIXA 1:	246.909.468,03	Cenário 1:	354.762.416,38
				Cenário 2:	(73.466.786,25)
				Cenário 3:	(444.274.681,21)

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
IGTA3	198.810,00	25.636,06	18.722,87	0,02%	62.500,74	211,99	(61.686,76)
INTB3	3.110.670,00	626.094,12	531.045,00	0,61%	-	-	-
IRBR3	390.676,00	27.622,92	16.561,67	0,02%	156.857,12	514,46	(143.725,02)
ITSA4	5.011.864,00	581.758,63	458.057,82	0,52%	1.436.463,09	4.926,63	(1.453.332,56)
ITUB4	49.863.710,31	8.092.409,33	6.206.818,95	7,11%	27.453.531,52	85.341,98	(22.389.479,50)
JBSS3	17.477.568,00	1.905.281,39	(572.110,10)	-0,66%	(1.390.257,89)	(5.646,96)	2.083.747,38
JHSF3	121.028,00	12.100,92	8.826,18	0,01%	23.695,01	84,40	(26.106,41)
JRDM11	821.633,40	53.856,04	40.800,19	0,05%	286.430,99	958,58	(274.397,10)
KLBN11	1.267.057,00	99.973,27	(67.096,79)	-0,08%	(117.278,92)	(479,70)	178.773,56
LAME3	4.794,00	4.925,93	2.047,95	0,00%	37.806,81	41,00	(4.547,69)
LAME4	2.642.362,40	2.642.705,16	1.106.662,98	1,27%	21.448.191,67	22.866,55	(2.511.248,94)
LCAM3	1.762.402,00	106.964,21	51.158,38	0,06%	(210.037,44)	(871,70)	331.689,27
LJQQ3	160.819,00	31.078,10	19.525,95	0,02%	(3.923,85)	(15,49)	5.489,87
LREN3	16.424.296,24	1.956.476,83	1.728.313,66	1,98%	6.304.235,58	20.814,79	(5.861.788,45)
LVB11	4.112.381,54	232.831,62	108.962,54	0,12%	865.937,95	3.064,84	(940.483,30)
LWSA3	6.791.190,00	855.977,43	130.805,10	0,15%	(258.722,39)	(1.028,31)	368.078,07
MALL11	7.828.352,73	393.828,51	3.627,13	0,00%	202.626,55	779,96	(267.179,93)
MATD3	1.192.116,84	220.825,29	(100.593,63)	-0,12%	-	-	-
MAXR11	1.451.378,25	2.180.390,83	(1.023.021,06)	-1,17%	732.267,52	2.313,21	(618.253,96)
MDNE3	208.800,00	39.537,75	13.929,59	0,02%	54.428,93	188,66	(56.387,35)
MGLU3	21.965.935,56	2.574.623,10	(635.630,78)	-0,73%	(5.917.070,59)	(26.861,33)	11.683.279,74
MOV13	11.711.178,00	990.586,08	(154.092,40)	-0,18%	(4.182.634,27)	(20.156,19)	9.636.918,48
MRFG3	405.818,00	30.920,75	(1.946,77)	0,00%	(55.019,66)	(230,44)	88.850,19
MRVE3	790.224,40	65.724,91	58.298,99	0,07%	404.815,31	1.275,31	(339.772,07)
MULT3	10.488.000,96	1.356.976,71	1.137.131,07	1,30%	6.153.808,52	18.894,94	(4.887.551,92)
NEWU11	600.237,00	-	-	0,00%	-	-	-
NTCO3	25.832.303,25	2.053.632,99	631.658,99	0,72%	(5.910.132,14)	(26.150,78)	10.936.787,48
OIBR3	1.184.456,90	209.988,26	45.042,93	0,05%	632.685,75	1.977,98	(522.330,28)
OMGE3	1.892.366,82	120.316,21	93.449,05	0,11%	449.929,73	1.574,34	(476.176,53)
PACUCAR_CBD ON ED	267.070,00	64.583,37	45.480,04	0,05%	142.205,52	444,84	(117.550,46)
PARD3	709.934,20	89.392,41	62.267,02	0,07%	237.293,33	798,59	(230.162,37)
PATC11	8.485.134,25	279.937,84	(91.847,27)	-0,11%	177.213,87	683,81	(235.019,34)
PETR3	31.736.166,00	5.555.940,59	4.132.035,31	4,73%	6.007.408,42	21.456,59	(6.660.937,09)
PETR4	51.429.783,87	8.533.741,62	6.217.007,30	7,12%	12.531.593,59	43.741,54	(13.189.355,59)
PETZ3	3.544.188,00	588.026,75	230.403,83	0,26%	71.751,02	276,95	(95.225,89)
PNVL3	1.698.753,00	220.631,04	183.957,03	0,21%	643.327,52	2.128,23	(600.752,72)
POWE3	121.800,00	829,94	(270,99)	0,00%	-	-	-
PRI03	9.297.780,32	699.018,77	330.142,70	0,38%	198.151,57	764,44	(262.657,44)
PVBI11	3.954.580,00	137.915,62	(53.359,90)	-0,06%	(297.245,00)	-	443.017,19
QAGR11	8.759.108,90	356.222,84	(9.116,78)	-0,01%	(70.040,72)	-	96.084,01



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.691.923.548,47	VAR / PL:	2,366%
VAR:	87.339.052,36	ETL / PL:	2,9667%
ETL:	109.526.732,79	VAR / CDI:	14659,96%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(283.740.111,72)	BAIXA 1:	246.909.468,03	Cenário 1:	354.762.416,38
				Cenário 2:	(73.466.786,25)
				Cenário 3:	(444.274.681,21)

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
QUAL3	722.812,00	79.200,48	53.299,77	0,06%	235.049,70	793,85	(229.794,14)
RADL3	11.676.600,00	1.267.115,36	558.301,91	0,64%	2.105.201,80	7.548,44	(2.355.013,84)
RAIL3	13.657.178,31	1.305.758,11	21.973,02	0,03%	115.519,10	448,48	(155.427,40)
RAPT4	6.092.856,00	658.433,40	283.987,34	0,33%	950.100,17	3.443,18	(1.089.056,81)
RBGS11	674.017,50	51.677,40	(24.434,28)	-0,03%	(22.310,40)	(88,45)	31.546,70
RBRL11	2.125.568,24	142.912,61	(30.555,46)	-0,03%	-	-	-
RCRB11	1.812.570,00	225.164,95	(65.661,32)	-0,08%	(123.420,12)	(498,27)	182.293,77
RDOR3	4.532.473,00	327.623,82	20.325,00	0,02%	(160.389,30)	-	-
RECV3	437.131,00	78.617,52	5.304,65	0,01%	-	-	-
RENT3	6.539.061,03	392.349,27	85.737,99	0,10%	(719.452,32)	(2.970,87)	1.122.284,25
RNGO11	165.928,08	5.303,24	(1.178,90)	0,00%	(6.919,62)	(27,55)	9.888,19
SANB11	882.145,00	133.812,10	107.733,65	0,12%	490.200,16	1.521,15	(398.267,41)
SBSP3	2.809.950,00	147.450,94	57.457,03	0,07%	1.038.302,51	3.446,95	(977.126,67)
SDIL11	391.766,70	17.652,16	(254,55)	0,00%	30.129,21	113,18	(37.523,81)
SEER3	505.752,00	141.693,68	85.682,83	0,10%	58.587,42	216,17	(69.989,11)
SMFT3	81.200,00	21.167,58	(7.982,56)	-0,01%	-	-	-
SOMA3	153.467,00	27.680,41	1.398,11	0,00%	(55.475,42)	(268,17)	128.867,64
SPY	3.499.512,53	238.175,29	(142.708,46)	-0,16%	(455.317,09)	(31.603,25)	729.787,82
STBP3	9.757.498,00	1.157.187,05	819.906,50	0,94%	(1.089.508,38)	(4.503,00)	1.703.255,53
SULA11	2.828.461,77	386.128,15	191.790,71	0,22%	1.114.117,72	3.664,53	(1.027.285,87)
SUZB3	18.818.579,75	1.648.000,52	(1.240.176,41)	-1,42%	698.067,71	2.672,45	(908.757,60)
TAAE11	457.200,00	43.017,25	31.064,77	0,04%	102.815,53	361,70	(110.147,17)
TCSA3	166.391,00	33.512,38	23.857,38	0,03%	97.206,19	298,72	(77.346,53)
TEND3	1.460.102,00	114.745,73	60.926,47	0,07%	343.590,27	1.203,48	(364.470,59)
TEPP11	8.820.868,24	630.681,92	(325.581,11)	-0,37%	(649.502,26)	(2.629,86)	966.128,32
TIMS3	662.973,00	51.525,27	35.352,64	0,04%	261.510,28	859,97	(241.017,68)
TOTS3	12.648.636,00	1.305.855,37	660.577,07	0,76%	(1.993.271,55)	(8.453,60)	3.319.279,13
TRXF11	13.617.271,50	401.169,73	99.071,96	0,11%	1.300.621,86	4.843,77	(1.587.592,13)
UGPA3	9.396.252,90	659.669,62	446.360,08	0,51%	3.840.827,34	12.562,84	(3.498.323,43)
USIM5	583.520,00	84.899,94	(36.213,78)	-0,04%	(128.517,33)	(565,68)	234.706,68
VALE3	102.529.196,77	5.711.463,00	311.514,59	0,36%	(17.238.931,46)	(73.558,07)	29.141.437,39
VISC11	5.625,00	276,67	(10,83)	0,00%	125,47	0,48	(166,13)
VIVT3	1.001.620,00	88.201,69	70.436,96	0,08%	437.052,95	1.415,00	(389.264,28)
VTV_LUS	4.947.543,39	423.370,22	(286.702,52)	-0,33%	(609.319,39)	(44.527,89)	967.423,98
VVAR3	1.148.400,00	289.362,07	163.026,98	0,19%	235.199,73	834,49	(256.872,44)
VVPR11	1.086.602,50	-	-	0,00%	-	-	-
WEGE3	10.864.291,00	1.061.301,94	(339.964,57)	-0,39%	(740.650,87)	(2.990,27)	1.094.068,49
WEST3	45.500,00	-	-	0,00%	-	-	-
WSPU21	2.899.010,40	267.476,22	(178.068,99)	-0,20%	(357.030,37)	(26.091,09)	566.861,56
XPIN11	2.089.611,00	102.543,86	9.830,18	0,01%	350.120,79	-	(396.664,27)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.691.923.548,47	VAR / PL:	2,366%
VAR:	87.339.052,36	ETL / PL:	2,9667%
ETL:	109.526.732,79	VAR / CDI:	14659,96%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(283.740.111,72)	BAIXA 1:	246.909.468,03	Cenário 1:	354.762.416,38
				Cenário 2:	(73.466.786,25)
				Cenário 3:	(444.274.681,21)

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
XPIN13	294.229,80	-	-	0,00%	-	-	-
XPPR11	3.728.339,20	312.446,34	(146.723,41)	-0,17%	(489.963,99)	-	786.726,40
YDUQ3	4.818.801,12	924.126,33	749.405,07	0,86%	2.558.306,95	8.007,15	(2.117.241,66)
INDQ21	-	804.471,93	708.101,61	0,81%	-	-	-
WINQ21	-	4.973.885,58	4.378.047,56	5,01%	-	-	-
DI1Q21	-	8.811,32	4.993,38	0,01%	(10.307,26)	5.381,38	16.014,69
DI1U21	-	24.623,71	(7.168,74)	-0,01%	(88.807,14)	46.297,34	137.640,80
DI1V21	-	207.558,64	(89.802,40)	-0,10%	(1.229.551,95)	640.472,20	1.903.058,97
DI1F22	-	807.945,75	498.842,05	0,57%	2.510.697,49	(1.303.754,50)	(3.865.791,02)
DI1J22	-	1.858,79	933,86	0,00%	5.439,20	(2.815,90)	(8.332,50)
DI1N22	-	1.320,54	597,72	0,00%	3.824,32	(1.974,57)	(5.832,44)
DAPQ22	-	75.762,74	15.827,13	0,02%	32.839,11	(12.012,17)	(72.988,19)
DI1V22	-	2.055,14	880,93	0,00%	6.191,93	(3.188,35)	(9.400,57)
DI1F23	-	4.149.915,25	1.699.125,73	1,95%	13.037.030,16	(6.696.068,80)	(19.709.446,24)
DAPK23	-	174.367,34	86.008,82	0,10%	139.544,65	(50.793,88)	(306.585,87)
DI1N23	-	16.269,69	9.147,97	0,01%	54.417,72	(27.802,08)	(81.544,74)
DI1F24	-	674.463,65	486.737,25	0,56%	2.169.902,46	(1.102.755,32)	(3.223.076,15)
DI1N24	-	5.361,54	4.176,74	0,00%	17.678,10	(8.936,94)	(26.029,50)
DAPQ24	-	252.724,23	142.753,52	0,16%	269.075,62	(97.284,19)	(581.880,10)
DI1F25	-	681.559,08	(553.688,22)	-0,63%	(2.259.331,87)	1.135.882,47	3.296.287,94
DAPK25	-	44.089,50	22.872,73	0,03%	-	-	-
DAPQ26	-	61.569,14	34.147,99	0,04%	-	-	-
DI1F27	-	77.392,15	64.499,46	0,07%	288.042,38	(141.682,98)	(405.311,75)
DAPQ28	-	42.098,20	28.258,88	0,03%	-	-	-
DI1F29	-	93.400,37	73.876,03	0,08%	392.181,85	(188.617,70)	(531.784,88)
DAPQ30	-	0,02	(0,01)	0,00%	(0,04)	0,02	0,09
DI1F31	-	5.170,79	3.901,89	0,00%	24.418,87	(11.474,08)	(31.872,97)
AFSQ21	-	20.924,74	(16.512,09)	-0,02%	(56.372,86)	(2.732,56)	97.748,37
DOLQ21	-	520.388,49	(352.404,80)	-0,40%	(749.262,16)	(54.662,89)	1.189.686,31
WDOQ21	-	529.061,63	358.278,22	0,41%	761.749,87	55.573,93	(1.209.514,42)
DOLU21	-	522.749,40	354.116,66	0,41%	755.883,76	52.713,33	(1.202.142,39)
WDOU21	-	1.415.779,62	959.065,96	1,10%	2.047.185,19	142.765,28	(3.255.802,30)
COMPROMISSADA	287.466.529,77	6.374,86	(3.612,64)	0,00%	7.457,14	(3.893,35)	(11.586,39)
EMP AÇÃO PROVISÃO	(81.690,09)	9,10	0,28	0,00%	(31,10)	16,22	48,22
DE252 AEGEA SA CDI - AEGP13	1.048.078,35	62,81	(3,93)	0,00%	143,78	(74,11)	(218,68)
DE252 AERIS CDI - AERI11	1.255.248,60	533,06	337,22	0,00%	1.837,18	(934,07)	(2.731,08)
DE252 ALIANSCE CDI - ALSCA0	4.086.707,59	17.584,70	15.359,69	0,02%	59.396,91	(29.356,91)	(84.234,89)
DE252 AMPL CDI - AMPLA0	3.220.895,24	1.778,19	(1.232,02)	0,00%	(5.741,58)	2.938,88	8.630,92
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.730.358,39	180,03	55,03	0,00%	561,79	(287,97)	(846,55)
DE252 BCBF CDI - BCBF14	274.056,79	88,78	52,77	0,00%	303,42	(154,57)	(452,52)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.691.923.548,47	VAR / PL:	2,366%
VAR:	87.339.052,36	ETL / PL:	2,9667%
ETL:	109.526.732,79	VAR / CDI:	14659,96%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(283.740.111,72)	BAIXA 1:	246.909.468,03	Cenário 1:	354.762.416,38
				Cenário 2:	(73.466.786,25)
				Cenário 3:	(444.274.681,21)

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 BCBF CDI - BCBF15	2.653.917,72	923,70	562,81	0,00%	3.175,87	(1.616,73)	(4.731,04)
DE252 BKBR CDI - BKBR18	1.464.213,95	253,12	124,74	0,00%	844,26	(431,12)	(1.264,19)
DE252 BRKA CDI - BRKP18	2.715.370,59	1.547,57	1.003,99	0,00%	5.272,19	(2.681,99)	(7.844,49)
DE252 BRML CDI - BRML17	3.171.268,67	2.558,78	(2.141,27)	0,00%	(8.448,11)	4.263,58	12.404,74
DE252 CELPA CDI - CELP15	2.577.222,59	144,78	(18,54)	0,00%	305,91	(157,85)	(466,15)
DE252 COELCE CDI - CEAR15	4.232.758,92	13.241,99	10.225,01	0,01%	43.645,94	(22.074,67)	(64.313,56)
DE252 COPEL GT CDI - CPGT14	289.588,65	367,58	(205,95)	0,00%	(1.185,88)	611,12	1.802,86
DE252 COPEL GT CDI - CPGT16	289.062,79	201,71	(148,65)	0,00%	(670,00)	341,88	1.001,96
DE252 CORSAN CDI - RSAN24	1.653.693,95	9.479,24	8.216,63	0,01%	30.819,15	(15.512,64)	(45.031,09)
DE252 COSAN LO CDI - RLOG11	2.649.908,58	799,65	464,59	0,00%	2.706,87	(1.379,32)	(4.038,88)
DE252 CTEEP CDI - CTEE19	1.078.616,40	1.235,00	979,35	0,00%	4.544,37	(2.269,53)	(6.558,75)
DE252 DASA CDI - DASAA2	2.673.489,79	333,09	132,20	0,00%	1.085,65	(555,19)	(1.629,56)
DE252 ECORODOV CDI - ERDV18	1.873.939,30	11.551,42	9.217,42	0,01%	47.180,30	(22.888,20)	(64.892,82)
DE252 ECORODOV CDI - ERDV A0	2.136.175,34	333,01	99,43	0,00%	1.017,72	(524,30)	(1.546,44)
DE252 ELEKTRO CDI - ELEK27	3.121.851,91	2.189,35	(1.224,36)	0,00%	(7.137,23)	3.670,28	10.812,13
DE252 ENERG TR CDI - ETEN13	3.040.148,44	24.234,36	19.231,78	0,02%	98.417,32	(48.098,50)	(137.104,60)
DE252 ENERSUL CDI - ESUL18	979.499,34	322,75	(163,10)	0,00%	(938,02)	488,31	1.450,31
DE252 GETI CDI - TIET19	2.419.253,33	9.126,44	7.058,53	0,01%	41.094,45	(19.523,63)	(54.623,51)
DE252 GETI CDI - TIET27	7.195.615,55	338,39	(117,58)	0,00%	384,90	(198,86)	(587,84)
DE252 GUAR CDI - GUAR24	3.618.847,88	1.581,83	984,99	0,00%	5.408,11	(2.753,83)	(8.059,91)
DE252 IGUATEMI CDI - IGTA37	2.116.765,49	1.855,71	(1.513,51)	0,00%	(6.046,38)	3.066,34	8.950,04
DE252 INTERVIA CDI - IVIA35	1.322.568,20	242,35	127,56	0,00%	819,69	(417,91)	(1.224,18)
DE252 LAME CDI - LAMEA1	367.487,63	47,91	12,41	0,00%	135,47	(70,31)	(208,43)
DE252 LIGHT CDI - LIGH1B	1.169.661,13	241,96	119,00	0,00%	805,28	(411,83)	(1.208,80)
DE252 LOCALIZA CDI - LORTA1	1.140.413,65	215,56	(143,44)	0,00%	(570,88)	297,07	882,06
DE252 MOV_PART CDI - MOV133	1.415.429,81	65,65	(35,13)	0,00%	0,02	-	(0,02)
DE252 MULTIPLA CDI - MULP16	3.122.364,60	2.038,48	(1.619,60)	0,00%	(6.499,15)	3.308,13	9.679,28
DE252 NATURA CDI - NATU27	1.755.742,99	81,43	(43,58)	0,00%	0,02	-	(0,03)
DE252 OMEGA GE CDI - OMGE13	3.340.869,78	2.469,14	1.934,13	0,00%	9.269,32	(4.619,79)	(13.333,51)
DE252 OURO VER CDI - OVSA10	2.192.997,57	1.187,13	840,41	0,00%	4.132,61	(2.091,77)	(6.098,04)
DE252 RD COLIN CDI - RDCO10	3.309.575,78	20.004,50	16.993,37	0,02%	66.509,75	(33.523,79)	(97.352,93)
DE252 RENNER CDI - LRENB1	1.414.284,55	262,20	129,49	0,00%	877,70	(448,13)	(1.313,94)
DE252 RT BANDE CDI - CBAN22	3.380.655,98	1.624,44	1.174,04	0,00%	5.781,52	(2.916,33)	(8.482,86)
DE252 SABEREDU CDI - SSED11	936.288,15	43,42	(23,24)	0,00%	0,01	-	(0,02)
DE252 SANEAMEN CDI - SNGO18	2.632.382,29	779,16	457,28	0,00%	2.667,42	(1.358,83)	(3.978,18)
DE252 SBF COME CDI - SBFC11	4.184.235,72	21.675,52	17.658,54	0,02%	67.797,69	(34.508,18)	(100.881,58)
DE252 SUL AME CDI - SULM15	1.315.687,24	264,45	(144,53)	0,00%	(813,62)	421,06	1.245,62
DE252 TELF BR CDI - VIVT15	5.091.619,37	17.644,28	8.836,35	0,01%	39.999,74	(21.087,81)	(63.070,42)
DE252 USIMINAS CDI - USIM17	3.425.550,57	6.127,00	3.335,93	0,00%	18.346,16	(9.451,85)	(27.869,17)
DE252 VAMOS CDI - VAM022	2.772.171,50	1.093,05	740,76	0,00%	3.819,45	(1.934,85)	(5.643,70)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.691.923.548,47	VAR / PL:	2,366%
VAR:	87.339.052,36	ETL / PL:	2,9667%
ETL:	109.526.732,79	VAR / CDI:	14659,96%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(283.740.111,72)	BAIXA 1:	246.909.468,03	Cenário 1:	354.762.416,38
				Cenário 2:	(73.466.786,25)
				Cenário 3:	(444.274.681,21)

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 VAMOS CDI - VAMO23	297.051,06	547,15	441,39	0,00%	2.164,32	(1.062,97)	(3.039,09)
LF selic	8.993.709,77	5.802,87	(4.660,18)	-0,01%	(18.304,84)	9.556,88	28.440,93
LF252 B.ALFA CDI - LF0021006S0	995.003,50	46,15	(24,70)	0,00%	0,01	-	(0,02)
LFSN B VOTORA CDI - LFSN14000H2	2.273.753,23	191,94	(112,00)	0,00%	(598,30)	312,05	927,94
LFSN BRADESCO CDI - LFSN210029N	3.360.022,73	155,84	(83,40)	0,00%	0,04	0,00	(0,06)
LFT	170.774.071,84	274.772,37	(106.350,82)	-0,12%	2,10	(0,00)	(2,85)
CMTR33	5.187.570,80	34.924,07	(1.333,84)	0,00%	(2.321,12)	853,69	5.225,96
CRI RB CAPIT IPCA M D - 17H0164854	8.581.720,93	99.058,26	53.121,70	0,06%	136.194,67	(49.334,36)	(272.310,99)
DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23	11.850.393,16	163.814,78	88.096,19	0,10%	203.105,55	(74.025,32)	(417.810,33)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.981.018,54	59.550,16	31.987,44	0,04%	63.462,67	(22.996,17)	(132.034,29)
DE252 CEMIG - IPCA CMDT33	2.517.903,63	25.038,94	11.244,58	0,01%	22.444,90	(8.121,68)	(48.633,24)
DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17	39.861.911,57	593.468,59	(14.712,35)	-0,02%	1.382.127,17	(48.353,29)	(39.013.032,80)
DE252 CSMG IPCA - CSMGC3	12.899.024,79	147.151,28	76.469,27	0,09%	161.113,54	(58.628,85)	(333.359,01)
DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24	13.774.287,06	101.816,26	40.606,11	0,05%	70.833,44	(25.787,70)	(155.690,66)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	10.342.072,67	139.503,83	74.768,04	0,09%	171.032,24	(62.546,72)	(351.528,74)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36	3.320.679,03	39.700,10	21.324,96	0,02%	42.308,44	(15.330,78)	(88.022,86)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	2.953.623,17	18.382,54	2.217,76	0,00%	4.045,95	(1.472,71)	(8.888,64)
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	445.236,74	2.738,20	(10,19)	0,00%	187,76	(68,64)	(416,66)
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	591.353,07	3.116,13	295,10	0,00%	1.030,72	(377,25)	(2.294,10)
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	3.024.576,38	16.614,34	(763,72)	0,00%	842,62	(298,23)	(1.728,12)
DE252 IMED - IPCA SULM23	1.090.488,75	6.178,99	80,82	0,00%	854,11	(318,78)	(1.814,06)
DE252 IRB IPCA - IRBR12	13.657.099,66	208.285,37	118.745,67	0,14%	331.878,02	(120.361,60)	(660.049,90)
DE252 LIGHT IPCA - LIGHD7	5.370.063,50	78.086,82	42.406,15	0,05%	115.639,19	(41.105,11)	(234.901,35)
DE252 LIGHT IPCA - LVSVE29	4.623.084,88	30.970,65	9.563,28	0,01%	17.659,59	(6.431,41)	(37.639,66)
DE252 LOCALIZA IPCA - LORTA7	9.300.232,72	160.013,95	102.175,85	0,12%	397.275,34	(138.263,55)	(742.477,84)
DE252 MOVIDA L IPCA - MVLV16	6.114.466,04	132.353,53	88.194,82	0,10%	274.141,56	(97.201,62)	(566.464,17)
DE252 PETR IPCA - PETR45	15.790.591,47	168.002,90	89.625,76	0,10%	164.187,45	(59.368,50)	(346.425,86)
DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34	8.205.097,87	43.520,46	16.135,81	0,02%	44.062,99	(19.370,20)	(81.329,45)
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	9.961.204,95	63.523,75	12.349,83	0,01%	22.840,25	(8.322,58)	(50.304,93)
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	13.942.388,88	175.482,49	92.158,80	0,11%	193.746,29	(70.055,94)	(403.593,87)
DE252 TRANS AL - IPCA TAEE33	15.385.101,88	128.795,74	55.434,51	0,06%	107.504,74	(38.923,64)	(233.254,89)
DE252 VAMOS IPCA - VAMO33	6.161.684,78	105.758,22	69.856,92	0,08%	261.841,43	(93.318,35)	(486.395,21)
DEBI ANEMUS IPCA - ANEM11	2.271.302,89	42.154,95	27.489,02	0,03%	119.317,98	(43.023,03)	(207.341,28)
DEBI ANET IPCA - ANET11	6.981.692,13	97.509,30	56.612,77	0,06%	153.038,29	(54.477,59)	(304.885,31)
DEBI B2W IPCA - BTOW15	10.301.706,26	175.088,65	116.168,20	0,13%	458.766,23	(165.461,44)	(838.518,53)
DEBI BRISANET IPCA - BRST11	3.432.190,78	52.625,28	30.434,78	0,03%	85.382,43	(30.496,99)	(170.041,61)
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	8.916.514,91	157.009,94	95.215,87	0,11%	400.663,93	(133.907,10)	(753.158,16)
DEBI CAGECE IPCA - CAEC21	9.071.181,66	164.167,58	81.031,99	0,09%	190.991,16	(49.492,05)	(451.717,12)
DEBI CORSAN IPCA - RSN44	4.663.579,65	74.597,32	45.324,77	0,05%	142.030,51	(49.290,19)	(278.032,57)
DEBI ELETROB IPCA - ELET42	11.997.556,27	200.709,11	126.698,76	0,15%	391.764,19	(137.195,34)	(765.303,90)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.691.923.548,47	VAR / PL:	2,366%
VAR:	87.339.052,36	ETL / PL:	2,9667%
ETL:	109.526.732,79	VAR / CDI:	14659,96%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(283.740.111,72)	BAIXA 1:	246.909.468,03	Cenário 1:	354.762.416,38
				Cenário 2:	(73.466.786,25)
				Cenário 3:	(444.274.681,21)

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 ENERMIR IPCA - ENMI21	1.011.489,76	13.778,69	7.724,10	0,01%	19.713,39	(7.142,54)	(39.609,51)
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	27.040.602,68	418.467,03	275.591,97	0,32%	944.806,25	(345.831,77)	(1.771.858,28)
DEBI IGUA SAN IPCA - IGSN15	10.958.987,31	183.640,86	116.274,96	0,13%	440.992,28	(155.989,20)	(814.805,61)
DEBI JAGUARA IPCA - ENUG21	1.673.407,97	22.029,01	12.255,14	0,01%	30.847,16	(11.179,67)	(62.088,30)
DEBI LAME IPCA - LAMEA6	9.472.412,17	156.507,10	104.224,05	0,12%	409.209,86	(148.951,84)	(745.382,14)
DEBI METRORIO IPCA - MTRJ19	6.736.337,91	115.403,40	74.660,12	0,09%	244.490,27	(88.551,93)	(464.025,83)
DEBI MG050 IPCA - CRMG15	2.261.526,51	34.976,43	21.752,81	0,02%	69.692,07	(24.775,26)	(133.941,60)
DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16	5.930.915,23	105.395,16	65.678,59	0,08%	200.193,83	(68.426,32)	(398.545,39)
DEBI NORTE EN IPCA - NTEN11	4.921.488,03	75.919,30	47.854,38	0,05%	151.124,68	(55.071,52)	(288.640,97)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS11	1.410.108,23	17.669,95	9.945,53	0,01%	27.460,72	(9.882,69)	(54.388,67)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS21	4.178.423,20	67.399,90	43.912,78	0,05%	201.373,31	(73.157,80)	(349.503,78)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS22	4.576.545,99	74.599,23	47.430,19	0,05%	190.521,61	(66.686,08)	(351.693,36)
DEBI PARANAGU IPCA - PASN12	714.547,58	9.573,75	5.620,72	0,01%	16.402,65	(5.868,69)	(32.049,25)
DEBI QUATA IPCA - QUAT12	4.455.205,81	63.308,80	34.110,64	0,04%	93.795,75	(34.313,01)	(187.932,36)
DEBI RIO PR IPCA - RIPR22	535.766,08	9.514,55	6.063,69	0,01%	22.151,10	(7.547,95)	(42.313,09)
DEBI TAUBATE IPCA - LTTE15	9.554.805,85	161.085,67	97.609,27	0,11%	390.020,09	(133.250,24)	(716.946,55)
DEBI VENSJOR IPCA - VSJH11	1.322.296,11	17.850,13	10.769,48	0,01%	30.757,59	(11.487,72)	(59.259,95)
DEBI VIARONDO IPCA - VRDN12	11.433.832,25	197.047,04	124.480,56	0,14%	480.717,81	(167.471,76)	(891.107,73)
ECCR32	6.871.513,80	36.982,06	1.395,56	0,00%	6.602,37	(2.394,65)	(14.379,00)
LF ipca	1.302.218,46	8.842,96	3.314,24	0,00%	6.985,70	(2.546,48)	(15.400,67)
LFS ITAU IPCA - LFS0120016V	5.010.456,46	27.232,91	5.965,71	0,01%	12.100,48	(4.425,70)	(26.887,14)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GU	791.061,00	5.182,47	1.691,85	0,00%	3.105,84	(1.134,11)	(6.874,86)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GZ	3.955.304,99	25.912,33	8.459,26	0,01%	15.529,18	(5.670,55)	(34.374,32)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H2	9.492.731,99	62.189,58	20.302,23	0,02%	37.270,03	(13.609,33)	(82.498,36)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H4	7.119.548,99	46.642,19	15.226,67	0,02%	27.952,52	(10.207,00)	(61.873,77)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H6	5.537.426,99	36.277,26	11.842,97	0,01%	21.740,85	(7.938,78)	(48.124,05)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001IP	7.923.857,91	52.761,79	17.566,58	0,02%	32.261,79	(11.778,99)	(71.390,17)
LFSN BRADESCO IPCA - LFSN16000GM	11.915.385,47	195.692,92	106.122,04	0,12%	234.438,35	(84.569,69)	(504.298,37)
LFSN BRADESCO IPCA M D - LFSN1800DC5	3.862.593,13	65.701,92	33.749,21	0,04%	90.276,74	(32.480,98)	(193.011,83)
NTNB	1.951.139.538,29	37.883.944,93	32.876.334,56	37,64%	189.900.427,74	(62.098.058,74)	(327.839.555,77)
DOLUPDB	63.323,69	318.003,06	215.421,17	0,25%	5.840.308,41	40.193,65	(63.223,24)
IBOVH138	(710,24)	3.555,37	(3.122,28)	0,00%	(198.629,18)	(37,61)	710,07
IBOV123	46.340,50	93.155,24	(81.807,43)	-0,09%	(46.240,62)	(969,03)	550.189,37
IDIFQHK	801,88	3.952,10	2.945,52	0,00%	25.096,85	(861,27)	(863,19)
IDIFQHL	(1.876,03)	8.810,14	(6.566,24)	-0,01%	(44.269,75)	2.006,67	2.012,45
IDIFQHM	(4.895,40)	21.862,83	(16.294,45)	-0,02%	(121.678,46)	5.213,91	5.233,32
IDIFQHN	9.244,08	39.178,36	29.199,74	0,03%	199.056,46	(9.801,48)	(9.848,54)
IDIFQHP	2.690,75	10.798,20	8.047,91	0,01%	984.257,92	(2.839,50)	(2.857,05)
IDIFQHV	(63.476,79)	186.527,99	(139.018,14)	-0,16%	(2.572.091,32)	64.951,57	66.324,76
IDIFQHW	94.311,01	267.422,32	199.307,89	0,23%	1.637.847,75	(96.162,32)	(98.390,19)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.691.923.548,47	VAR / PL:	2,366%
VAR:	87.339.052,36	ETL / PL:	2,9667%
ETL:	109.526.732,79	VAR / CDI:	14659,96%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(283.740.111,72)	BAIXA 1:	246.909.468,03	Cenário 1:	354.762.416,38
				Cenário 2:	(73.466.786,25)
				Cenário 3:	(444.274.681,21)

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
IDIVPDX	303,31	1.317,64	960,40	0,00%	195.669.154,66	(241,66)	(250,64)
IDIVPDY	(2.601,56)	10.347,41	(7.542,05)	-0,01%	(200.255.020,83)	2.083,03	2.184,55
IDIVPDZ	4.909,99	17.760,75	12.945,52	0,01%	(238.063.030,43)	(3.936,78)	(4.188,37)
AB AMERICAN GROWTH	7.508.599,24	853.662,66	(626.133,97)	-0,72%	213.192.976,81	(67.577,39)	1.468.203,19
BTG MAS CASH FIR DI	15.054,54	18,20	(11,32)	0,00%	30.622.041,41	(0,95)	334,99
FIDC CELG DIST SN B	3.936.747,90	67.703,02	(17.051,37)	-0,02%	(37.566.876,52)	2.272,00	(717.164,37)
FIDC CREDZ MZ4	359.681,96	744,82	(295,58)	0,00%	38.263.326,71	-	(16.261,29)
FIDC VERDECARD SN4	9.000.000,00	14.381,48	(3.116,08)	0,00%	95.595.606,01	-	4.409,89
FII VIA PQ SHOPPING	1.556.213,34	-	-	0,00%	(195.807.582,97)	-	-
FUNDSMITH EQ FUND	9.735.276,62	922.797,48	(631.722,13)	-0,72%	100.209.722,51	(87.617,49)	1.903.599,29
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.181.634,98	385.928,53	4.953,02	0,01%	(924.728,65)	-	-
JANUS H GL FICFIA IE	3.748.650,22	408.718,14	(81.150,81)	-0,09%	(241,85)	-	-
LOOMIS US GROWTH	7.734.438,83	508.683,31	(255.631,60)	-0,29%	627.914,78	(69.609,95)	1.512.363,01
MFS MERIDIAN EUROPEA	5.424.359,39	356.752,59	(179.280,97)	-0,21%	12.456,30	(48.819,23)	1.060.658,78
PICTET GL FIC FIM IE	3.648.208,81	346.445,19	(54.676,49)	-0,06%	(3.243,81)	-	-
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	3.643.233,96	47.763,94	(10.471,89)	-0,01%	-	-	-
WELLINGTON GLO QUAL	9.567.585,51	926.167,43	(620.620,63)	-0,71%	(1.198.957,21)	(86.108,27)	1.870.809,60
Total	4.004.613.260,56	173.985.650,86	87.339.052,36	100,00%	354.762.416,38	(73.466.786,25)	(444.274.681,21)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

EMBRAERPREV RENDA FIXA CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	1.918.929.740,33	VAR / PL:	2,059%
VAR:	39.515.694,72	ETL / PL:	2,5824%
ETL:	49.554.292,38	VAR / CDI:	12761,08%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(214.871.595,22)	BAIXA 1:	229.436.597,12	Cenário 1:	152.401.272,44
				Cenário 2:	(60.734.591,66)
				Cenário 3:	(275.264.434,11)

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	5,15	2,23	0,00%	(93,70)	(0,37)	129,72
RECEBER	(91.961,58)	78,97	(34,23)	0,00%	1.436,15	5,64	(1.988,17)
COMPROMISSADA	83.132.858,10	69.816,71	30.306,98	0,08%	(1.296.112,05)	(6.229,53)	1.793.938,01
CMTR33	5.188.718,26	33.347,76	5.922,40	0,01%	(83.252,07)	498,48	117.179,66
17H0164854	8.550.014,75	98.177,73	74.082,37	0,19%	6.713,07	(51.111,83)	(95.383,61)
AEGP23	11.800.302,31	162.794,46	118.480,19	0,30%	25.960,54	(77.116,31)	(177.087,59)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.964.853,84	59.115,96	42.739,76	0,11%	(11.731,43)	(24.079,91)	(29.511,09)
CMDT33	2.512.041,19	24.480,61	16.468,08	0,04%	(15.800,80)	(8.626,77)	3.616,66
GASP17	39.365.557,85	561.601,27	228.862,83	0,58%	750.149,12	(45.038,16)	(1.867.454,54)
CSMGC3	12.858.674,95	145.940,35	105.030,02	0,27%	(33.799,61)	(61.379,75)	(67.428,48)
GEPA24	13.753.173,78	99.901,25	63.012,23	0,16%	(140.247,09)	(27.969,93)	133.639,90
ERDV17	10.298.730,58	138.530,30	100.716,86	0,25%	16.246,32	(65.193,17)	(141.061,95)
ERDV36	3.309.902,56	39.410,64	28.493,17	0,07%	(7.820,95)	(16.053,27)	(19.674,06)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	2.953.011,17	17.098,18	6.732,31	0,02%	(41.734,45)	(1.776,18)	54.217,44
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	445.014,83	2.579,27	617,48	0,00%	(6.727,34)	(108,61)	9.127,43
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	590.849,42	2.920,32	1.138,87	0,00%	(8.098,43)	(449,30)	10.262,96
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	3.023.898,95	15.136,81	2.924,62	0,01%	(46.103,88)	(585,02)	63.033,67
SULM23	1.089.852,90	5.776,51	1.570,98	0,00%	(16.057,51)	(425,19)	21.508,52
DE252 PETR IPCA - PETR45	15.751.008,45	167.071,82	120.338,78	0,30%	(75.494,53)	(62.490,23)	(19.027,75)
RDCO34	8.194.773,54	42.393,50	27.612,94	0,07%	(82.321,72)	(20.513,68)	92.740,12
SBESC7	9.956.321,07	59.388,84	28.568,01	0,07%	(131.152,37)	(9.475,77)	161.685,35
SBSPC2	13.893.041,93	173.674,40	124.523,91	0,32%	(16.076,44)	(73.279,58)	(117.792,90)
TAEE33	15.357.329,61	125.863,32	82.920,95	0,21%	(127.229,25)	(41.691,48)	87.989,54
ELET42	11.914.781,43	200.970,65	170.200,06	0,43%	214.072,30	(140.098,08)	(523.179,36)
ENMI21	1.006.910,14	13.710,63	10.490,84	0,03%	4.578,31	(7.389,79)	(18.995,65)
ENTV12	26.847.138,37	422.015,31	370.811,98	0,94%	544.225,02	(352.725,54)	(1.223.955,60)
IGSN15	2.279.876,80	38.786,12	33.421,35	0,08%	58.247,50	(33.151,97)	(123.936,17)
ENJG21	1.666.201,05	21.908,36	16.691,57	0,04%	5.764,31	(11.578,37)	(27.910,00)
NEOE16	5.888.752,16	105.355,78	88.450,95	0,22%	112.582,64	(69.894,99)	(279.416,89)
ECCR32	6.868.578,80	33.795,70	10.503,08	0,03%	(99.844,57)	(3.114,52)	132.311,98
LFS0120016V	5.005.740,46	26.183,59	13.681,91	0,03%	(65.106,25)	(5.085,40)	79.202,90
LFS012001GU	790.136,60	5.016,67	3.099,72	0,01%	(9.049,51)	(1.249,48)	9.804,87
LFS012001GZ	3.950.682,99	25.083,35	15.498,59	0,04%	(45.247,55)	(6.247,40)	49.024,36
LFS012001H2	9.481.639,17	60.200,04	37.196,61	0,09%	(108.594,13)	(14.993,77)	117.658,47
LFS012001H4	7.111.229,37	45.150,03	27.897,46	0,07%	(81.445,59)	(11.245,33)	88.243,85
LFS012001H6	5.530.956,18	35.116,69	21.698,02	0,05%	(63.346,57)	(8.746,37)	68.634,11
LFS012001IP	7.913.961,83	51.091,99	31.821,26	0,08%	(89.455,36)	(12.945,25)	95.610,17
LFSN16000GM	11.853.109,33	194.059,85	140.173,19	0,35%	59.152,40	(88.769,41)	(268.182,29)
LFSN1800DC5	3.839.394,93	65.232,41	46.366,27	0,12%	33.894,59	(33.973,33)	(117.234,72)
NTNB	1.798.127.495,66	37.318.937,78	37.266.660,17	94,31%	153.270.193,36	(59.340.292,74)	(273.334.773,00)
Total	2.176.980.553,71	40.707.719,09	39.515.694,72	100,00%	152.401.272,44	(60.734.591,66)	(275.264.434,11)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	823.013.369,05	VAR / PL:	6,339%
VAR:	52.171.451,81	ETL / PL:	7,9495%
ETL:	65.425.127,78	VAR / CDI:	39282,85%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.550,08)	BAIXA 1:	1.803,43	Cenário 1:	127.467.395,58
				Cenário 2:	299.576,39
				Cenário 3:	(46.971.204,41)

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	26.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	1.774.460,29	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	25.570.771,21	4.104.324,70	3.708.105,65	7,11%	11.426.954,18	36.853,26	(10.092.086,80)
ALSO3	1.681.470,00	243.727,88	211.317,39	0,41%	835.077,83	2.645,37	(709.340,57)
AMER3	5.946.010,00	1.696.840,42	1.215.472,70	2,33%	-	-	-
ASAI3	8.882.706,36	634.603,16	295.471,36	0,57%	-	-	-
AZUL4	696.310,00	157.326,02	146.345,83	0,28%	563.127,17	1.610,64	(385.097,13)
B3SA3	29.436.449,76	1.696.517,39	96.507,49	0,18%	3.023.601,96	11.223,22	(3.662.472,05)
UNT	22.083.458,33	2.099.852,80	1.533.208,40	2,94%	(2.310.459,97)	(9.512,53)	3.578.325,11
BBAS3	14.141.773,00	2.150.693,58	1.843.490,49	3,53%	6.533.925,05	20.956,80	(5.701.725,34)
BBDC3	1.408.123,50	192.453,91	173.104,39	0,33%	737.267,76	2.313,45	(613.530,63)
BBDC4	37.596.739,26	5.828.175,41	5.376.455,24	10,31%	20.659.377,63	64.245,43	(16.861.962,77)
BBRK3	26.100,00	10.190,43	530,19	0,00%	(11.965,35)	(62,33)	33.960,72
BBSE3	1.175.350,00	146.464,12	131.127,40	0,25%	664.089,50	2.054,17	(535.855,95)
BEEF3	118.404,00	7.362,08	4.832,01	0,01%	30.206,85	104,94	(31.454,99)
BIDH11	9.279.641,28	1.595.261,11	(396.617,34)	-0,76%	(4.783.088,97)	(26.174,50)	15.558.026,91
BIDI4	6.349,42	1.062,77	(190,55)	0,00%	(3.118,85)	(16,70)	9.554,72
BKBR3	199.880,00	33.295,58	26.456,45	0,05%	33.282,95	120,06	(37.746,66)
BMGB4	176.700,00	16.003,94	11.489,04	0,02%	58.939,11	198,41	(57.202,32)
BPAN4	2.443.716,00	901.969,97	832.771,66	1,60%	794.210,36	2.682,55	(776.579,26)
BRAP4	5.384.288,00	580.694,05	(360.745,57)	-0,69%	(1.978.742,43)	(9.607,20)	4.649.612,44
BRDT3	4.762.414,65	370.256,07	281.842,72	0,54%	(1.010.331,13)	(4.425,13)	1.822.461,12
BRFS3	1.134.966,00	250.839,36	195.247,59	0,37%	553.979,05	1.760,24	(473.675,16)
BRKM5	837.375,00	105.074,18	64.861,48	0,12%	(160.435,96)	(694,07)	280.625,67
BRML3	4.903.466,40	703.134,26	548.213,37	1,05%	2.521.372,10	7.937,81	(2.113.161,75)
CCRO3	6.449.300,00	471.479,90	332.123,04	0,64%	501.433,30	1.882,92	(623.925,60)
CESP6	10.410.537,72	310.032,51	(146.712,57)	-0,28%	436.231,46	1.666,18	(564.811,62)
CIEL3	3.820.414,00	653.643,11	556.848,96	1,07%	2.873.368,05	8.362,26	(2.037.479,21)
CLSA3	798.313,50	41.684,05	(12.795,59)	-0,02%	-	-	-
CMIG4	704.328,66	128.732,42	104.388,98	0,20%	408.667,53	1.257,57	(326.114,96)
COGN3	366.912,00	85.592,72	76.862,82	0,15%	291.508,22	837,38	(201.151,35)
CPFE3	7.993.524,00	698.531,36	596.838,13	1,14%	3.985.967,68	12.617,79	(3.380.564,95)
CPLB6	190.332,00	13.161,66	2.983,64	0,01%	29.199,04	105,94	(33.555,25)
CRFB3	1.587.564,00	174.591,27	161.170,90	0,31%	794.345,12	2.513,02	(672.815,97)
CSAN3	1.630.090,00	140.908,50	(7.356,97)	-0,01%	(244.139,28)	(1.030,79)	402.102,09
CSED3	5.470.000,00	1.244.403,13	901.823,87	1,73%	-	-	-
CSNA3	14.352.250,00	1.925.128,61	(174.743,04)	-0,33%	(2.329.119,56)	(9.904,69)	3.904.464,40
CVCB3	274.290,00	80.362,55	69.132,48	0,13%	146.884,02	458,99	(121.141,46)
CYRE COM-CPP ON	220.892,00	23.989,89	18.910,54	0,04%	93.401,24	303,91	(84.100,93)
CYRE3	319.005,00	29.874,42	25.443,86	0,05%	153.751,81	489,61	(132.090,59)
ECOR3	196.380,00	26.572,79	23.891,34	0,05%	117.653,79	359,75	(92.616,14)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	823.013.369,05	VAR / PL:	6,339%
VAR:	52.171.451,81	ETL / PL:	7,9495%
ETL:	65.425.127,78	VAR / CDI:	39282,85%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.550,08)	BAIXA 1:	1.803,43	Cenário 1:	127.467.395,58
				Cenário 2:	299.576,39
				Cenário 3:	(46.971.204,41)

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
EGIE3	527.227,00	23.042,50	19.926,97	0,04%	107.037,54	380,06	(117.103,14)
ELET3	3.111.445,75	565.755,85	548.611,28	1,05%	993.322,84	3.362,70	(976.185,79)
ELET6	8.237.043,15	1.466.719,84	1.420.532,02	2,72%	2.883.983,28	9.645,96	(2.759.234,09)
ENBR3	217.551,00	11.665,77	8.973,85	0,02%	63.274,50	216,64	(63.773,59)
ENEV3	1.120.926,00	101.531,03	68.142,01	0,13%	119.261,25	441,94	(143.897,45)
ENH11	1.201.446,00	133.630,69	126.410,06	0,24%	450.822,20	1.493,37	(422.217,43)
EQLT3	12.368.571,61	877.598,79	658.029,94	1,26%	1.370.264,66	5.067,49	(1.645.666,90)
ESPA3	1.422.778,50	182.001,78	117.466,32	0,23%	-	-	-
EUCATEX PN	77.448,00	15.720,92	11.937,65	0,02%	43.846,50	135,57	(35.350,65)
EZTC3	143.000,00	20.994,35	19.125,12	0,04%	111.766,53	322,33	(77.759,75)
FLRY3	387.776,00	37.505,87	34.958,09	0,07%	172.509,39	556,77	(152.601,45)
GGBR4	1.672.440,00	214.223,47	19.849,19	0,04%	250.110,21	908,97	(288.554,13)
GGPS3	2.184.224,90	497.962,95	(102.089,05)	-0,20%	-	-	-
GMAT3	3.583.960,35	212.891,42	169.786,74	0,33%	829.395,05	2.909,82	(883.044,95)
GNDI3	11.969.760,00	875.135,87	736.756,30	1,41%	2.296.110,94	8.192,05	(2.539.582,09)
GOAU4	538.650,00	55.697,13	8.729,31	0,02%	31.993,26	121,18	(40.620,19)
GOLL4	3.653.945,60	761.516,35	692.054,74	1,33%	3.866.350,64	10.296,84	(2.283.745,07)
HAPV3	19.891.789,72	1.659.645,88	1.382.310,05	2,65%	4.402.237,38	15.510,35	(4.732.230,45)
HBSA3	406.455,00	56.637,17	23.601,48	0,05%	41.764,88	155,02	(50.587,54)
HGTX3	509.640,00	111.493,64	86.907,96	0,17%	(188.849,85)	(918,95)	446.364,46
HYPE3	7.340.335,00	591.243,25	332.113,31	0,64%	1.016.223,03	3.711,54	(1.185.815,20)
IFCM3	4.440.000,00	1.519.409,34	(1.153.677,31)	-2,21%	-	-	-
IGTA3	191.901,00	23.894,59	16.295,16	0,03%	49.786,07	172,65	(51.636,45)
INTB3	3.199.230,00	621.325,53	567.726,67	1,09%	-	-	-
IRBR3	387.944,00	26.556,38	14.821,96	0,03%	143.997,73	477,74	(135.322,24)
ITSA4	4.893.577,00	552.508,86	480.367,27	0,92%	1.321.578,94	4.563,14	(1.357.367,99)
ITUB4	49.326.491,12	7.759.225,63	6.434.282,81	12,33%	24.754.807,92	78.273,64	(20.943.371,51)
JBSS3	17.537.760,01	1.975.189,72	(1.115.686,67)	-2,14%	(2.004.384,03)	(8.296,23)	3.144.563,71
JHSF3	117.868,00	11.474,40	5.804,38	0,01%	17.322,44	63,03	(20.037,70)
KLBN11	1.230.338,00	98.629,65	(44.560,88)	-0,09%	(73.242,56)	(294,36)	107.015,55
LAME4	2.356.007,00	2.424.877,40	1.766.500,41	3,39%	25.090.872,73	22.660,71	(2.272.223,14)
LCAM3	1.659.269,75	101.827,50	29.971,81	0,06%	(196.578,26)	(815,53)	310.140,04
LTREN3	15.491.630,00	1.801.024,40	1.629.426,57	3,12%	5.407.831,53	18.094,70	(5.178.543,87)
LWSA3	6.621.078,00	824.734,30	272.819,63	0,52%	(70.927,86)	(278,01)	97.616,35
MATD3	1.192.116,84	221.408,08	(156.813,48)	-0,30%	-	-	-
MDNE3	207.176,00	38.510,18	23.356,61	0,04%	62.442,21	212,89	(62.342,80)
MGLU3	18.607.980,01	2.098.748,98	(828.399,40)	-1,59%	(4.759.902,90)	(21.420,98)	9.192.943,39
MOVI3	11.480.643,00	993.361,95	(410.211,56)	-0,79%	(4.258.011,94)	(20.724,55)	10.070.626,50
MRFG3	396.122,00	29.130,96	(2.931,48)	-0,01%	(48.722,20)	(202,64)	77.340,28
MRVE3	601.276,20	50.721,96	45.331,52	0,09%	306.770,21	967,14	(257.888,40)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	823.013.369,05	VAR / PL:	6,339%
VAR:	52.171.451,81	ETL / PL:	7,9495%
ETL:	65.425.127,78	VAR / CDI:	39282,85%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.550,08)	BAIXA 1:	1.803,43	Cenário 1:	127.467.395,58
				Cenário 2:	299.576,39
				Cenário 3:	(46.971.204,41)

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
MULT3	10.010.285,10	1.257.808,64	919.040,02	1,76%	5.015.397,15	15.863,14	(4.245.895,58)
NTCO3	24.265.598,76	2.173.180,46	842.470,12	1,61%	(4.691.912,46)	(20.319,21)	8.228.258,51
OMGE3	1.826.624,52	111.877,29	76.925,65	0,15%	408.538,28	1.437,98	(438.180,51)
PACUCAR_CBD ON ED	263.755,00	65.088,62	58.390,87	0,11%	154.941,34	475,63	(122.997,43)
PARD3	692.997,40	85.660,92	72.622,42	0,14%	233.757,09	785,74	(226.129,95)
PETR3	30.915.500,01	5.490.564,04	5.006.219,72	9,60%	7.194.430,90	25.227,00	(7.650.441,12)
PETR4	49.765.389,59	8.342.951,81	7.721.877,78	14,80%	13.871.884,37	47.727,97	(14.135.167,40)
PETZ3	3.368.900,00	563.303,92	364.856,04	0,70%	213.055,59	805,52	(269.355,90)
PNVL3	1.653.120,00	213.328,02	192.533,33	0,37%	645.962,12	2.127,20	(597.173,36)
POWE3	121.800,00	848,90	(449,14)	0,00%	-	-	-
PRI03	9.029.672,40	839.168,89	555.054,76	1,06%	691.033,44	2.596,36	(860.987,20)
QUAL3	705.550,00	78.171,26	61.600,69	0,12%	241.997,79	811,65	(232.955,04)
RADL3	11.138.412,00	1.176.602,24	231.486,93	0,44%	1.442.157,98	5.288,40	(1.698.483,04)
RAIL3	13.493.893,07	1.271.260,46	(405.111,85)	-0,78%	(299.029,59)	(1.178,87)	417.241,83
RAPT4	5.969.768,00	625.980,55	62.138,73	0,12%	700.205,69	2.581,83	(835.201,04)
RDOR3	4.284.900,00	299.550,19	65.887,53	0,13%	(128.607,32)	-	-
RECV3	427.571,00	79.339,05	31.298,52	0,06%	-	-	-
RENT3	5.666.029,05	341.164,71	(8.924,02)	-0,02%	(614.445,97)	(2.535,06)	956.466,43
SANB11	871.610,00	128.315,64	106.898,07	0,20%	443.126,96	1.397,91	(373.028,57)
SBSP3	2.787.156,00	140.605,46	39.242,00	0,08%	942.489,74	3.167,02	(911.073,22)
SEER3	498.888,00	140.006,60	115.055,13	0,22%	89.022,09	319,46	(99.768,55)
SOMA3	145.665,00	25.597,13	(5.580,07)	-0,01%	(54.215,19)	(264,13)	128.547,38
STBP3	9.445.050,00	1.150.661,78	1.031.393,21	1,98%	(861.005,80)	(3.519,09)	1.310.071,05
SULA11	2.749.459,59	381.356,75	292.160,92	0,56%	1.170.665,41	3.804,93	(1.051.585,56)
SUZB3	16.410.245,00	1.437.736,66	(845.602,35)	-1,62%	1.243.544,76	4.673,91	(1.550.653,50)
TAE11	456.000,00	40.995,41	26.812,39	0,05%	84.094,13	300,99	(93.690,69)
TCSA3	160.035,00	32.769,48	28.095,97	0,05%	101.701,61	307,23	(78.021,21)
TEND3	1.422.062,00	115.908,64	63.460,49	0,12%	366.554,46	1.272,03	(380.766,53)
TIMS3	653.164,00	49.647,43	27.260,76	0,05%	230.684,84	770,65	(220.128,95)
TOTS3	12.602.304,00	1.346.929,35	967.157,44	1,85%	(1.645.927,09)	(6.874,55)	2.639.904,12
UGPA3	8.707.081,76	582.606,54	342.024,49	0,66%	3.158.308,34	10.512,23	(2.989.349,21)
USIM5	575.960,00	81.597,48	(36.382,95)	-0,07%	(135.072,17)	(599,78)	252.195,43
VALE3	96.204.854,39	5.734.730,11	1.124.262,20	2,15%	(14.898.599,04)	(63.087,33)	24.714.506,63
VIVT3	1.005.524,00	85.904,15	69.579,27	0,13%	396.949,71	1.305,21	(365.747,27)
VVAR3	1.095.330,00	287.251,39	217.414,78	0,42%	334.064,48	1.137,33	(332.466,92)
WEGE3	10.737.997,00	1.049.868,86	(414.624,71)	-0,79%	(827.928,18)	(3.358,51)	1.237.024,34
WEST3	45.500,00	-	-	0,00%	-	-	-
YDUQ3	3.911.184,00	755.882,70	715.245,70	1,37%	2.207.489,32	6.829,67	(1.782.027,54)
INDQ21	-	33.679,66	33.510,44	0,06%	-	-	-
COMPROMISSADA	24.112.619,89	540,51	(438,25)	0,00%	626,79	(327,24)	(973,85)
EMP AÇÃO PROVISÃO	(81.687,51)	10,29	(0,89)	0,00%	(31,54)	16,45	48,90
LFT	295.041,40	101,80	(75,47)	0,00%	0,00	(0,00)	(0,00)
Total	823.392.686,35	95.838.540,18	52.171.451,81	100,00%	127.467.395,58	299.576,39	(46.971.204,41)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FIR F EMB II CNPJ - 11005764000196

Dados Gerais

PL:	1.721.747.375,52	VAR / PL:	2,273%
VAR:	39.137.226,85	ETL / PL:	2,8506%
ETL:	49.079.678,24	VAR / CDI:	14086,32%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(209.740.203,24)	BAIXA 1:	226.240.129,08	Cenário 1:	84.088.200,81
				Cenário 2:	(60.277.475,97)
				Cenário 3:	(173.354.738,61)

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	15,63	4,85	0,00%	(249,53)	(1,00)	360,23
RECEBER	(52.398,21)	163,77	(50,81)	0,00%	2.615,00	10,46	(3.775,04)
COMPROMISSADA	65.514.604,98	205.252,86	63.143,83	0,16%	(3.267.885,79)	(13.963,89)	4.717.373,36
GASP17	32.617.175,73	507.337,46	225.344,97	0,58%	(496.871,68)	(41.825,25)	97.425,87
CSMGC3	12.858.674,59	169.564,56	119.892,28	0,31%	(474.716,01)	(63.156,91)	580.979,74
DE252 PETR IPCA - PETR45	15.751.008,00	196.130,17	137.926,17	0,35%	(615.587,34)	(64.667,13)	775.228,53
SBESC7	9.730.040,77	84.553,88	39.804,26	0,10%	(461.809,01)	(10.605,17)	648.655,21
SBSPC2	7.865.348,55	112.300,60	79.799,15	0,20%	(278.799,63)	(42.573,24)	329.929,27
ELET42	11.914.781,09	216.838,01	182.820,58	0,47%	(194.478,54)	(141.744,78)	77.632,34
ENTV12	11.599.123,55	196.339,39	170.911,35	0,44%	(162.598,41)	(153.995,75)	56.092,73
IGSN15	2.279.876,74	41.490,71	35.563,44	0,09%	(19.928,13)	(33.467,06)	(8.971,69)
NEOE16	5.888.751,99	113.252,04	94.953,58	0,24%	(89.339,21)	(70.708,86)	17.527,82
LFS0120016V	5.005.740,32	39.012,67	18.990,23	0,05%	(236.750,14)	(5.777,23)	331.621,07
LFS012001GU	790.136,57	6.945,32	3.978,60	0,01%	(36.142,83)	(1.358,68)	49.648,10
LFS012001GZ	3.950.682,87	34.726,60	19.893,00	0,05%	(180.714,15)	(6.793,42)	248.240,48
LFS012001H2	9.481.638,90	83.343,83	47.743,21	0,12%	(433.713,95)	(16.304,20)	595.777,15
LFS012001H4	7.111.229,17	62.507,88	35.807,41	0,09%	(325.285,46)	(12.228,15)	446.832,86
LFS012001H6	5.530.956,02	48.617,24	27.850,21	0,07%	(252.999,80)	(9.510,78)	347.536,67
NTNB	1.798.127.444,50	37.856.306,23	37.832.850,56	96,67%	91.613.455,44	(59.588.804,92)	(182.662.853,30)
Total	2.005.969.816,14	39.974.698,85	39.137.226,85	100,00%	84.088.200,81	(60.277.475,97)	(173.354.738,61)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FI RF EMB V CREDITO PRIVADO CNPJ - 20726178000121

Dados Gerais

PL:	197.182.364,81	VAR / PL:	0,776%
VAR:	1.529.578,08	ETL / PL:	0,9728%
ETL:	1.918.153,27	VAR / CDI:	4807,07%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(5.932.492,84)	BAIXA 1:	2.592.828,91	Cenário 1:	2.200.188,37
				Cenário 2:	(723.859,36)
				Cenário 3:	(4.454.344,91)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiância:	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%	-	-	-
RECEBER	(39.563,37)	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	17.618.251,25	394,93	80,69	0,01%	457,97	(239,10)	(711,56)
CMTR33	5.188.718,26	35.470,05	20.261,37	1,32%	(2.220,65)	816,88	5.001,87
17H0164854	8.550.014,75	96.685,07	96.270,30	6,29%	140.237,33	(50.587,18)	(280.231,14)
AEGP23	11.800.302,31	160.195,67	157.844,13	10,32%	210.244,04	(76.392,20)	(432.204,90)
CCRDD1	4.964.853,84	58.093,46	57.534,84	3,76%	65.803,93	(23.775,25)	(136.849,03)
CMDT33	2.512.041,19	24.267,40	24.033,36	1,57%	23.429,36	(8.472,63)	(50.692,56)
100 - GASP17	6.748.381,19	97.845,21	55.970,52	3,66%	233.985,42	(7.306,72)	(466.032,07)
GEPA24	13.753.173,77	98.794,59	96.083,70	6,28%	74.534,10	(27.125,99)	(163.697,62)
ERDV17	10.298.730,58	136.319,36	134.556,04	8,80%	177.080,01	(64.561,21)	(363.715,94)
ERDV36	3.309.902,56	38.728,97	38.356,56	2,51%	43.869,28	(15.850,17)	(91.232,69)
ECPT11	2.953.011,17	17.932,31	13.320,87	0,87%	4.382,27	(1.594,97)	(9.625,35)
ECPT21	445.014,83	2.740,18	1.770,57	0,12%	222,39	(81,30)	(493,59)
ECPT31	590.849,41	3.031,93	2.446,43	0,16%	1.128,78	(413,04)	(2.510,95)
ECPT41	3.023.898,95	16.333,61	8.803,17	0,58%	1.119,88	(399,46)	(2.341,68)
SULM23	1.089.852,90	6.141,47	4.156,48	0,27%	962,55	(358,32)	(2.053,62)
RDCO34	8.194.773,53	42.139,66	40.830,14	2,67%	45.654,80	(20.010,82)	(84.427,25)
SBESC7	226.280,02	1.397,39	1.153,46	0,08%	553,04	(201,47)	(1.217,41)
SBSPC2	6.027.693,15	74.198,54	73.602,27	4,81%	87.158,56	(31.423,51)	(181.422,17)
TAE33	15.357.329,61	124.804,26	122.539,95	8,01%	112.603,80	(40.749,10)	(244.029,12)
ENMI21	1.006.910,14	13.499,31	13.348,58	0,87%	20.303,07	(7.328,00)	(40.764,60)
ENTV12	15.248.014,49	236.202,39	222.254,31	14,53%	547.222,18	(199.397,20)	(1.024.809,20)
ENJG21	1.666.201,05	21.566,45	21.362,48	1,40%	31.785,12	(11.476,13)	(63.932,53)
ECCR32	6.868.578,80	36.017,49	24.098,16	1,58%	7.420,96	(2.693,04)	(16.183,65)
LFS012001IP	7.913.961,82	51.146,05	48.805,21	3,19%	34.135,76	(12.459,63)	(75.486,18)
LFSN16000GM	11.853.109,33	191.323,55	187.552,18	12,26%	244.260,58	(88.042,06)	(524.441,26)
D - LFSN1800DC5	3.839.394,92	64.395,03	62.542,31	4,09%	93.853,83	(33.737,73)	(200.240,73)
Total	171.010.680,44	1.649.664,34	1.529.578,08	100,00%	2.200.188,37	(723.859,36)	(4.454.344,91)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FIM EMB I A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	149.111.756,74	VAR / PL:	0,362%
VAR:	540.230,26	ETL / PL:	0,4543%
ETL:	677.470,77	VAR / CDI:	2245,14%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(193.556,66)	BAIXA 1:	170.925,71	Cenário 1:	2.081.692,37
				Cenário 2:	(67.901,02)
				Cenário 3:	2.049.019,08

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	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(576.985,59)	-	-	0,00%	-	-	-
AMER3	511.671,10	146.017,95	134.751,10	24,94%	-	-	-
B3SA3	210.450,00	12.128,91	4.577,42	0,85%	21.616,64	80,24	(26.184,11)
BRIT3	186.528,00	-	-	0,00%	-	-	-
CASH3	237.650,00	50.522,18	(29.361,60)	-5,44%	(196.215,55)	-	2.313.677,98
CBAV3	128.250,00	3.064,32	(284,20)	-0,05%	-	-	-
CSAN3	480.340,00	41.521,63	(3.285,46)	-0,61%	(71.940,73)	(303,74)	118.487,76
CURY3	59.280,00	7.025,33	5.555,64	1,03%	7.643,53	28,04	(9.007,08)
ENEV3	246.900,00	22.363,66	13.649,17	2,53%	26.269,00	97,34	(31.695,47)
ENJU3	27.576,00	5.966,54	4.322,20	0,80%	23.519,20	-	(15.648,44)
EQTL3	307.340,00	21.806,98	9.583,74	1,77%	34.048,97	125,92	(40.892,29)
GNDI3	104.000,00	7.603,67	6.189,89	1,15%	19.949,90	71,18	(22.065,32)
HAPV3	496.627,00	41.435,43	34.998,24	6,48%	109.908,16	387,24	(118.146,91)
LAME4	175.661,84	180.796,76	158.500,78	29,34%	1.870.753,72	1.689,56	(169.414,99)
LJQQ3	161.695,00	31.201,77	26.124,74	4,84%	(1.964,18)	(7,70)	2.707,89
LREN3	586.460,00	68.180,61	45.912,96	8,50%	204.721,96	685,00	(196.041,92)
MGLU3	620.616,20	69.997,80	8.339,83	1,54%	(158.753,01)	(714,44)	306.604,46
MRVE3	170.646,00	14.395,21	12.078,26	2,24%	87.063,33	274,48	(73.190,36)
MULT3	126.090,00	15.843,41	4.948,00	0,92%	63.174,17	199,81	(53.481,49)
NTCO3	865.375,00	77.501,32	54.184,42	10,03%	(167.325,92)	(724,64)	293.441,31
PETZ3	235.252,00	39.335,80	32.178,87	5,96%	14.877,78	56,25	(18.809,26)
RADL3	196.872,00	20.796,50	(3.868,54)	-0,72%	25.490,22	93,47	(30.020,77)
RDOR3	220.800,00	15.435,76	1.617,16	0,30%	(6.627,11)	-	-
RENT3	391.545,00	23.575,83	1.911,26	0,35%	(42.460,65)	(175,18)	66.095,61
SMFT3	79.721,00	20.434,14	(12.396,98)	-2,29%	-	-	-
STBP3	19.932,00	2.428,26	1.736,11	0,32%	(1.816,99)	(7,43)	2.764,66
SUZB3	200.059,00	17.527,60	(3.141,30)	-0,58%	15.160,18	56,98	(18.904,18)
UGPA3	297.024,00	19.874,41	7.219,81	1,34%	107.739,13	358,60	(101.975,44)
VALE3	282.776,00	16.856,16	3.179,29	0,59%	(43.791,62)	(185,43)	72.643,62
DI1F22	-	12.870,75	5.958,49	1,10%	38.984,13	(20.239,48)	(60.004,22)
DI1F23	-	7.428,35	(2.416,83)	-0,45%	(23.107,47)	11.860,65	34.895,89
COMPROMISSADA	121.436.523,88	2.722,12	(2.039,88)	-0,38%	3.156,66	(1.648,06)	(4.904,51)
DE252 AERIS CDI - AERI11	1.254.848,50	555,20	250,85	0,05%	1.888,05	(958,85)	(2.801,47)
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.730.249,21	178,93	17,97	0,00%	576,93	(295,50)	(868,23)
DE252 BCBF CDI - BCBF14	273.992,29	91,97	38,12	0,01%	311,83	(158,69)	(464,26)
ETEN13	3.020.642,15	25.503,20	16.644,15	3,08%	100.081,85	(48.822,19)	(139.008,66)
IVIA35	1.322.391,88	247,88	84,46	0,02%	842,61	(429,16)	(1.256,28)
LAMEA1	367.464,11	47,22	(1,81)	0,00%	138,61	(71,93)	(213,18)
LIGH1B	1.169.497,56	247,42	74,74	0,01%	827,28	(422,71)	(1.240,01)
LORTA1	605.566,04	119,68	(65,01)	-0,01%	(309,26)	160,90	477,69
MOVI33	1.415.429,81	65,33	(46,57)	-0,01%	0,02	-	(0,02)
DE252 NATURA CDI -	632.884,10	29,21	(20,82)	0,00%	0,01	(0,00)	(0,01)
OMGE13	1.121.085,26	868,06	526,00	0,10%	3.183,08	(1.583,79)	(4.566,21)
CBAN22	1.097.123,16	551,43	293,25	0,05%	1.926,53	(970,43)	(2.820,20)
SSED11	681.862,02	31,47	(22,44)	0,00%	0,01	-	(0,01)
SULM15	1.315.822,50	280,59	(132,69)	-0,02%	(834,61)	431,75	1.276,93
VIVT15	2.160.847,16	7.687,26	3.075,44	0,57%	17.775,01	(9.363,91)	(27.990,21)
VAMO22	1.114.209,50	458,02	224,07	0,04%	1.577,63	(798,18)	(2.326,29)
LF selic	4.015.273,79	2.094,85	(1.361,02)	-0,25%	(6.366,66)	3.323,00	9.887,09
LF0021006S0	995.003,50	45,92	(32,74)	-0,01%	0,01	(0,00)	(0,01)
LFT	437.388,64	47,64	(38,27)	-0,01%	0,00	-	(0,01)
Total	153.227.256,64	1.055.810,45	540.230,26	100,00%	2.081.692,37	(67.901,02)	2.049.019,08



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FIM EMB II A CNPJ - 20725957000102

Dados Gerais

PL:	142.372.125,19	VAR / PL:	1,626%
VAR:	2.314.779,14	ETL / PL:	2,0389%
ETL:	2.902.827,43	VAR / CDI:	10075,38%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(3.768.709,09)	BAIXA 1:	4.555.980,20	Cenário 1:	463.716,54
				Cenário 2:	(1.035.872,15)
				Cenário 3:	(114.790,00)

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	7,73	6,25	0,00%	(140,55)	(0,55)	194,58
RECEBER	(22.466,20)	19,29	(15,60)	0,00%	350,85	1,38	(485,71)
WSPU21	2.928.722,94	265.534,21	(191.237,94)	-8,26%	(426.743,40)	(26.538,22)	673.985,52
WINQ21	-	2.138.658,30	2.002.844,36	86,52%	-	-	-
DI1V21	-	486,49	244,01	0,01%	2.575,36	(1.341,38)	(3.985,43)
DI1F22	-	2.145,13	1.414,27	0,06%	6.497,35	(3.373,25)	(10.000,70)
DI1J22	-	1.893,71	1.000,60	0,04%	5.560,42	(2.877,76)	(8.513,76)
DI1N22	-	1.341,04	636,02	0,03%	3.913,11	(2.019,61)	(5.963,89)
DI1V22	-	2.109,22	950,59	0,04%	6.351,03	(3.268,55)	(9.633,68)
DI1F23	-	5.447,46	2.358,15	0,10%	16.945,48	(8.697,81)	(25.590,32)
DI1N23	-	17.025,85	9.584,41	0,41%	55.968,23	(28.568,97)	(83.745,23)
DI1F24	-	31.050,32	22.027,90	0,95%	97.878,64	(49.683,41)	(145.098,88)
DI1N24	-	5.653,03	4.278,72	0,18%	18.205,77	(9.190,51)	(26.742,93)
DI1F25	-	57.600,91	45.353,14	1,96%	187.397,98	(94.062,71)	(272.679,13)
DI1F27	-	33.034,28	26.882,89	1,16%	120.275,70	(59.032,08)	(168.634,75)
DI1F29	-	37.210,95	28.975,91	1,25%	152.973,86	(73.381,14)	(206.548,23)
DI1F31	-	5.356,15	3.991,84	0,17%	24.548,64	(11.500,24)	(31.885,17)
COMPROMISSADA	38.807.247,37	32.591,13	26.367,42	1,14%	(605.038,03)	(2.908,01)	837.428,16
AEGP13	1.048.054,10	870,92	719,06	0,03%	(16.219,96)	(140,22)	22.434,56
CPGT14	289.819,94	382,75	(17,16)	0,00%	(5.745,49)	610,26	8.117,86
CPGT16	289.219,68	243,56	45,54	0,00%	(5.207,41)	334,34	7.283,99
ERDV18	1.864.813,58	12.815,34	10.660,49	0,46%	18.711,80	(23.263,59)	(25.214,65)
ESUL18	979.657,98	782,80	499,79	0,02%	(16.262,94)	441,49	22.669,36
LORTA1	534.916,67	395,61	294,91	0,01%	(8.626,89)	109,31	11.986,62
NATU27	1.122.858,89	916,02	744,59	0,03%	(17.535,50)	(68,90)	24.275,69
SSED11	254.426,13	207,56	168,72	0,01%	(3.973,33)	(15,61)	5.500,58
VIVT15	2.920.063,73	11.272,08	7.244,85	0,31%	(21.581,90)	(12.833,11)	25.305,87
LF selic	3.667.265,20	2.637,35	1.373,85	0,06%	(61.651,61)	2.061,67	86.089,13
LFSN14000H2	2.273.795,53	1.792,26	1.435,50	0,06%	(36.115,58)	176,55	50.098,32
LFT	33.839.897,75	10.579,70	2.400,78	0,10%	(528.472,10)	(2.076,53)	731.603,09
NTNB	57.834.526,78	671.061,81	451.614,65	19,51%	913.089,49	(622.954,26)	(2.203.147,93)
IBOVH138	(102,63)	576,55	(538,71)	-0,02%	(95.039,27)	(6,13)	100,41
IBOVT123	106.335,52	158.470,56	(148.071,05)	-6,40%	(107.086,60)	(1.669,53)	606.138,85
IDIFQG0	(43,50)	66,78	(54,07)	0,00%	(1.239.420,03)	35,13	42,08
IDIFQG1	43,50	67,67	54,80	0,00%	1.328.099,31	(35,31)	(42,07)
IDIFQG7	60,00	101,58	82,26	0,00%	2.785.819,27	(50,21)	(57,97)
IDIFQG8	(120,00)	206,21	(166,98)	-0,01%	(5.976.708,42)	100,93	115,92
IDIFQG9	60,00	104,67	84,76	0,00%	3.205.407,67	(50,72)	(57,95)
IDIFQHM	(140,00)	708,24	(573,51)	-0,02%	(28.830.833,95)	134,68	131,92
IDIFQHN	280,00	1.374,66	1.113,15	0,05%	29.515.549,53	(269,58)	(264,13)
Total	148.748.192,97	3.512.799,86	2.314.779,14	100,00%	463.716,54	(1.035.872,15)	(114.790,00)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A CNPJ - 34081188000161

Dados Gerais

PL:	208.712.680,06	VAR / PL:	4,353%
VAR:	9.086.007,19	ETL / PL:	5,4593%
ETL:	11.394.223,49	VAR / CDI:	26977,47%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(33.119.281,70)	BAIXA 1:	34.012.770,58	Cenário 1:	33.083.951,24
				Cenário 2:	(9.339.751,70)
				Cenário 3:	(39.607.617,71)

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	500,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(1.559.705,89)	-	-	0,00%	-	-	-
AMER3	6.186,60	1.765,50	1.139,12	0,01%	-	-	-
ANIM3	453.974,00	105.086,08	71.649,77	0,79%	42.238,59	157,48	(51.694,90)
UNT	14.161,84	1.346,61	934,56	0,01%	(1.481,67)	(6,10)	2.294,73
CEAB3	12.181,80	3.022,89	2.237,29	0,02%	9.052,14	26,42	(6.456,70)
COGN3	707.845,32	165.125,16	116.544,61	1,28%	562.376,62	1.615,46	(388.060,47)
GNDI3	2.327.040,00	170.135,09	108.027,96	1,19%	446.386,73	1.592,62	(493.719,93)
LAME3	4.653,00	4.927,27	2.862,54	0,03%	48.832,34	44,51	(4.484,49)
LREN3	22.632,40	2.631,20	1.990,44	0,02%	7.900,54	26,44	(7.565,56)
MGLU3	1.604.657,60	180.985,44	(18.706,83)	-0,21%	(410.469,83)	(1.847,24)	792.752,71
OIBR3	1.164.879,10	212.032,92	98.398,28	1,08%	699.666,92	2.138,27	(550.171,86)
SUZB3	1.641.186,71	143.787,88	(50.449,52)	-0,56%	124.366,77	467,44	(155.080,68)
YDUQ3	698.813,28	135.053,95	105.946,75	1,17%	394.413,27	1.220,26	(318.395,79)
INDQ21	-	749.372,40	592.931,39	6,53%	-	-	-
WINQ21	-	2.702.792,57	2.138.550,29	23,54%	-	-	-
DI1U21	-	27.665,25	(16.624,60)	-0,18%	(90.085,01)	46.959,15	139.599,61
DI1V21	-	235.703,85	(175.493,05)	-1,93%	(1.247.761,40)	649.896,73	1.930.941,30
DI1F22	-	827.482,18	693.807,30	7,64%	2.506.354,62	(1.301.229,89)	(3.857.771,36)
DI1F23	-	4.271.799,07	3.003.066,44	33,05%	13.288.336,19	(6.820.664,67)	(20.067.463,72)
DI1F24	-	628.360,37	560.412,71	6,17%	1.980.754,64	(1.005.435,27)	(2.936.343,21)
DI1F25	-	795.745,91	(722.829,34)	-7,96%	(2.588.868,46)	1.299.458,86	3.767.011,68
DOLU21	-	524.596,88	368.130,29	4,05%	806.731,44	53.239,47	(1.295.157,49)
WDOU21	-	1.420.783,23	997.019,53	10,97%	2.184.897,65	144.190,23	(3.507.718,21)
COMPROMISSADA	6.388.347,41	143,20	(87,00)	0,00%	166,06	(86,70)	(258,01)
LFT	135.418.258,46	240.993,07	(143.176,16)	-1,58%	1,46	0,00	(1,99)
NTNB	63.799.614,90	1.440.514,04	1.200.190,88	13,21%	7.482.243,20	(2.420.688,28)	(12.626.460,44)
DOLUPDB	26.281,80	149.621,06	104.997,48	1,16%	5.607.412,16	19.784,57	(26.226,34)
IDIFQFP	70,30	105,08	95,30	0,00%	1.746.211,48	(56,19)	(69,54)
IDIFQFZ	(70,30)	106,45	(96,55)	0,00%	(1.869.878,97)	56,48	69,53
IDIFQGO	(70,30)	107,87	(97,83)	0,00%	(2.003.017,83)	56,77	69,52
IDIFQG1	70,30	109,32	99,15	0,00%	2.146.331,70	(57,06)	(69,51)
IDIFQHK	468,64	2.318,52	2.102,79	0,02%	183.848.794,53	(450,97)	(452,09)
IDIFQHL	(468,64)	2.434,21	(2.207,71)	-0,02%	(188.433.788,38)	450,49	451,28
IDIFQHM	(949,30)	4.801,71	(4.354,92)	-0,05%	(195.493.662,47)	913,20	915,04
IDIFQHN	1.628,32	7.993,07	7.249,33	0,08%	171.645.595,48	(1.567,60)	(1.571,26)
IDIFQHP	536,48	2.545,12	2.308,30	0,03%	28.931.730,36	(516,87)	(518,30)
IDIFQHV	(17.267,76)	63.485,52	(57.578,29)	-0,63%	(35.736.108,24)	16.667,03	16.812,37
IDIFQHW	27.018,09	96.703,13	87.705,04	0,97%	36.454.790,91	(26.079,85)	(26.324,12)
IDIVPDX	232,63	999,94	841,73	0,01%	92.051.855,24	(173,05)	(180,04)
IDIVPDY	(465,26)	2.193,00	(1.846,02)	-0,02%	(188.721.320,65)	341,57	351,22
IDIVPDZ	232,63	1.215,12	1.022,86	0,01%	96.669.466,29	(167,27)	(170,30)
BPACH132	6.984,70	13.397,95	9.292,88	0,10%	(6.513,15)	(28,13)	63.499,62
Total	212.749.458,87	15.339.989,08	9.086.007,19	100,00%	33.083.951,24	(9.339.751,70)	(39.607.617,71)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FIM EMB III A IMOBILIÁRIO CNPJ - 32711990000162

Dados Gerais

PL:	91.237.332,52	VAR / PL:	1,901%
VAR:	1.734.222,60	ETL / PL:	2,3837%
ETL:	2.174.785,85	VAR / CDI:	11779,02%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(25,69)	BAIXA 1:	25,77	Cenário 1:	2.529.737,97
				Cenário 2:	10.903,64
				Cenário 3:	(1.982.570,81)

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	1.000,00	35,21	(0,67)	0,00%	(1,26)	(0,00)	1,72
RECEBER	(283.555,22)	9.984,90	189,21	0,01%	358,44	1,40	(487,81)
BLCP11	1.526.877,30	53.766,33	(1.018,86)	-0,06%	(1.930,11)	(7,53)	2.626,75
BMLC11	1.740.481,50	61.288,03	(1.161,40)	-0,07%	(2.200,13)	(8,58)	2.994,22
BPML11	1.365.624,40	55.526,86	(22.017,02)	-1,27%	(44.108,76)	(174,58)	62.126,85
BTLG11	989.947,52	23.146,02	(2.541,89)	-0,15%	(28.310,53)	(111,84)	39.696,53
CBOP11	35.911,08	2.251,08	384,85	0,02%	2.842,63	10,65	(3.521,32)
CEOC11	561.176,21	18.413,38	8.905,58	0,51%	(24.407,30)	(97,16)	34.851,92
CJCT11	2.346.271,35	72.093,43	(26.832,75)	-1,55%	62.061,05	238,51	(81.527,16)
CNES11	608.968,80	36.000,90	(8.070,77)	-0,47%	124.664,56	441,82	(135.789,76)
HBRH11	1.373.149,33	48.353,06	(916,28)	-0,05%	(1.735,79)	(6,77)	2.362,28
HSML11	8.040.738,30	560.382,88	(217.518,22)	-12,54%	1.255.614,01	4.544,55	(1.434.896,85)
JRDM11	819.840,00	55.125,02	(26.967,94)	-1,56%	250.353,18	851,26	(248.411,92)
LVBI11	4.113.165,00	248.317,74	2.951,83	0,17%	805.712,05	2.866,28	(885.168,46)
MALL11	7.907.427,00	203.787,75	(118.182,20)	-6,81%	2.237,12	8,66	(2.989,46)
MAXR11	1.450.525,00	2.159.345,02	1.837.660,85	105,96%	615.162,97	1.998,54	(551.928,67)
NEWU11	600.237,00	21.136,30	(400,53)	-0,02%	(758,76)	(2,96)	1.032,61
PATC11	8.592.381,30	233.718,38	41.459,08	2,39%	118.556,82	458,44	(158.012,28)
PVBI11	4.047.134,00	112.626,24	41.922,32	2,42%	(311.352,99)	(19,96)	463.675,74
QAGR11	8.775.729,60	143.336,80	(51.948,18)	-3,00%	(158.605,52)	(43,28)	219.601,66
RBGS11	664.102,92	37.508,31	1.597,44	0,09%	(33.552,70)	(134,05)	48.329,66
RBRL11	2.127.182,80	77.990,43	(9.010,30)	-0,52%	(2.688,96)	(10,49)	3.659,48
RCRB11	1.804.384,20	178.909,94	87.327,25	5,04%	(199.538,74)	(823,13)	310.521,38
RNGO11	165.476,90	4.216,88	375,04	0,02%	(7.176,65)	(28,57)	10.246,20
SDIL11	393.446,30	7.478,51	1.693,16	0,10%	21.895,93	82,98	(27.833,15)
TEPP11	8.807.909,08	415.075,47	160.311,98	9,24%	(775.896,28)	(3.161,88)	1.172.238,24
TRXF11	13.663.588,75	468.981,15	(167.636,60)	-9,67%	1.092.359,74	4.092,63	(1.352.004,23)
VISC11	5.590,00	149,34	(1,90)	0,00%	(22,89)	(0,09)	31,20
VVPR11	1.086.602,50	38.262,82	(725,07)	-0,04%	(1.373,57)	(5,36)	1.869,32
XPIN11	2.086.692,84	60.362,04	(7.499,97)	-0,43%	317.954,07	(10,29)	(364.747,08)
XPIN13	294.229,80	10.360,79	(196,33)	-0,01%	(371,93)	(1,45)	506,17
XPPR11	3.769.210,80	255.779,39	213.768,44	12,33%	(542.840,16)	(18,59)	884.077,57
COMPROMISSADA	964.689,83	33.953,99	(639,10)	-0,04%	(1.194,38)	(17,85)	1.620,63
FII VIA PQ SHOPPING	1.556.213,34	54.799,34	(1.038,44)	-0,06%	(1.967,20)	(7,67)	2.677,21
Total	92.002.349,53	5.762.463,75	1.734.222,60	100,00%	2.529.737,97	10.903,64	(1.982.570,81)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	580.559.377,13	VAR / PL:	0,844%
VAR:	4.901.248,24	ETL / PL:	1,0587%
ETL:	6.146.365,13	VAR / CDI:	5231,63%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(473,84)	BAIXA 1:	475,47	Cenário 1:	197.457.134,58
				Cenário 2:	470.570,53
				Cenário 3:	(79.186.266,51)

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	698,95	492,21	0,01%	1.824,30	4,60	(873,10)
RECEBER	1.001.679,80	70.012,88	49.303,50	1,01%	182.736,17	460,84	(87.456,35)
ABEV3	21.617.107,20	2.184.566,81	(1.157.519,93)	-23,62%	13.603.761,15	41.100,56	(10.419.066,29)
AMER3	3.268.194,20	786.122,75	(361.269,77)	-7,37%	596.215,78	1.503,60	(285.345,03)
ASAI3	7.523.824,00	571.726,53	483.607,07	9,87%	1.372.569,18	3.461,50	(656.902,76)
B3SA3	21.951.292,25	1.972.331,96	1.431.705,21	29,21%	6.259.322,90	18.468,53	(4.647.732,12)
UNT	17.942.232,00	1.231.767,28	701.428,98	14,31%	1.396.008,26	526,04	1.340.764,77
BBAS3	11.446.897,00	1.110.939,14	(682.707,94)	-13,93%	7.377.065,49	22.229,64	(5.614.621,65)
BBDC4	31.975.831,75	2.971.107,86	(2.030.078,53)	-41,42%	23.404.035,86	69.351,59	(17.132.811,90)
BIDI11	6.196.554,00	1.260.438,91	811.644,99	16,56%	(2.063.509,89)	(14.627,37)	9.847.976,53
BPAN4	2.443.716,00	749.463,73	(330.409,77)	-6,74%	1.240.016,81	3.806,84	(989.939,35)
BRAP4	3.616.644,00	585.972,94	443.101,16	9,04%	(669.344,43)	(4.789,27)	2.807.391,93
CCRO3	5.655.000,00	320.100,54	159.086,31	3,25%	1.471.316,57	4.252,72	(1.040.818,83)
CESP6	5.948.932,00	524.095,66	352.363,55	7,19%	1.334.539,41	3.689,05	(842.151,81)
CIEL3	3.615.248,00	426.431,53	(121.825,15)	-2,49%	3.378.589,55	9.576,46	(2.243.707,55)
CPFE3	5.436.204,00	237.871,25	(58.414,71)	-1,19%	3.702.486,26	11.082,10	(2.773.674,46)
CSED3	5.470.000,00	1.004.620,93	(359.218,16)	-7,33%	997.890,62	2.516,59	(477.584,02)
CSNA3	12.711.325,00	2.009.712,14	1.336.397,05	27,27%	256.097,50	(2.924,14)	2.348.236,33
ELET6	5.810.815,00	651.612,67	(343.878,47)	-7,02%	3.094.568,93	9.478,13	(2.453.839,78)
GNDI3	7.320.000,00	312.322,79	144.103,85	2,94%	2.739.551,79	8.377,50	(2.192.165,73)
GOLL4	3.454.620,00	512.489,25	(183.642,64)	-3,75%	4.285.663,57	11.324,51	(2.460.786,79)
HAPV3	17.340.678,00	845.682,38	297.459,38	6,07%	7.001.107,92	21.499,12	(5.639.333,60)
HYPE3	4.128.270,00	288.244,86	60.784,08	1,24%	1.324.652,09	3.986,70	(1.027.351,05)
IFCM3	4.440.000,00	1.767.568,52	1.099.247,62	22,43%	809.988,00	2.042,72	(387.655,03)
INTB3	3.199.230,00	428.625,59	(167.920,45)	-3,43%	583.634,66	1.471,88	(279.323,79)
ITUB4	40.460.711,10	4.192.688,32	(3.221.681,97)	-65,73%	27.686.697,37	82.819,83	(20.711.691,56)
JBSS3	14.739.795,00	2.389.690,49	1.331.431,94	27,17%	1.004.371,16	(191,29)	1.355.954,71
LAME4	2.027.031,00	1.987.898,82	(721.032,63)	-14,71%	21.957.153,08	20.429,11	(2.131.925,57)
LREN3	11.906.790,00	737.405,06	(134.649,16)	-2,75%	6.328.584,97	19.385,48	(5.019.781,30)
LWSA3	6.040.675,00	727.040,34	(17.855,33)	-0,36%	1.037.288,38	2.525,51	(438.350,16)
MGLU3	15.612.740,00	2.412.568,93	1.057.795,52	21,58%	(1.145.495,54)	(10.789,96)	6.350.054,53
MOVI3	11.480.643,00	1.507.658,53	708.449,07	14,45%	(2.163.601,34)	(15.442,63)	9.068.255,09
MULT3	8.688.535,00	760.177,32	(149.446,12)	-3,05%	5.938.215,18	17.765,94	(4.443.864,21)
NTCO3	13.260.125,00	1.192.977,35	165.026,17	3,37%	(144.891,01)	(5.002,98)	3.338.658,37
PETR3	22.885.500,00	2.664.134,38	(1.918.463,74)	-39,14%	9.500.743,12	29.203,51	(7.661.439,51)
PETR4	36.539.985,69	3.860.364,39	(2.517.394,51)	-51,36%	16.851.340,66	51.855,04	(13.568.970,09)
PETZ3	3.368.900,00	452.041,18	(45.205,56)	-0,92%	827.643,10	2.355,45	(563.493,52)
PNVL3	1.653.120,00	117.901,85	(78.016,39)	-1,59%	947.540,35	2.887,76	(741.506,76)
PRI03	5.140.800,00	366.859,65	42.664,31	0,87%	1.331.255,97	3.843,31	(939.021,46)
RADL3	9.656.824,00	1.113.989,81	550.866,24	11,24%	3.012.019,55	9.027,79	(2.315.691,79)
RAIL3	6.096.766,00	815.991,92	449.443,42	9,17%	977.124,81	2.272,32	(343.789,94)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	580.559.377,13	VAR / PL:	0,844%
VAR:	4.901.248,24	ETL / PL:	1,0587%
ETL:	6.146.365,13	VAR / CDI:	5231,63%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(473,84)	BAIXA 1:	475,47	Cenário 1:	197.457.134,58
				Cenário 2:	470.570,53
				Cenário 3:	(79.186.266,51)

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
RAPT4	5.969.768,00	721.556,14	383.152,94	7,82%	1.789.268,85	5.328,36	(1.356.419,64)
RDOR3	4.284.900,00	383.768,71	306.214,96	6,25%	653.085,82	1.971,36	(374.113,30)
SBSP3	2.127.600,00	158.090,09	105.698,16	2,16%	1.107.595,31	3.396,42	(881.235,84)
STBP3	9.445.050,00	638.026,71	(189.671,89)	-3,87%	862.052,11	826,31	485.426,65
SUZB3	11.397.956,00	1.617.494,00	1.195.484,17	24,39%	2.943.046,74	8.490,20	(2.072.179,24)
TOTS3	11.672.336,00	885.057,43	(13.193,40)	-0,27%	604.912,72	(997,14)	1.425.988,32
UGPA3	5.615.168,00	340.718,33	65.793,62	1,34%	3.061.156,09	9.362,68	(2.418.079,93)
VALE3	78.350.160,20	6.600.351,24	5.132.952,96	104,73%	2.159.835,94	(15.332,22)	13.287.003,93
WEGE3	7.856.200,00	1.091.521,30	242.105,71	4,94%	827.470,49	1.157,24	219.117,02
YDUQ3	3.447.720,00	445.131,33	(279.270,14)	-5,70%	2.574.874,84	7.606,58	(1.871.881,80)
COMPROMISSADA	17.796.412,92	1.244.214,28	876.210,43	17,88%	3.247.057,40	7.946,11	(1.554.518,08)
Total	581.046.506,11	62.249.845,74	4.901.248,24	100,00%	197.457.134,58	470.570,53	(79.186.266,51)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	60.335.968,20	VAR / PL:	1,303%
VAR:	786.433,96	ETL / PL:	1,6345%
ETL:	986.220,25	VAR / CDI:	8077,24%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(36,58)	BAIXA 1:	36,70	Cenário 1:	19.808.458,10
				Cenário 2:	54.324,66
				Cenário 3:	(11.416.634,56)

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	69,90	50,76	0,01%	182,43	0,46	(87,31)
RECEBER	(130.473,58)	9.119,51	(6.622,63)	-0,84%	(23.802,26)	(60,03)	11.391,61
ALSO3	1.681.470,00	149.978,02	(101.476,39)	-12,90%	1.141.827,95	3.418,97	(856.149,20)
AMER3	1.610.480,00	387.380,58	(7.166,14)	-0,91%	293.799,43	740,94	(140.610,51)
ASAI3	942.818,36	71.643,66	18.250,59	2,32%	171.998,10	433,76	(82.317,18)
B3SA3	1.903.200,00	171.003,24	139.533,15	17,74%	542.689,84	1.601,24	(402.963,24)
BBAS3	483.939,00	46.967,03	(34.969,99)	-4,45%	311.879,25	939,80	(237.368,64)
BBRK3	26.100,00	10.274,50	3.044,85	0,39%	(7.203,93)	(50,32)	31.681,94
BBSE3	391.071,00	26.415,40	(8.663,98)	-1,10%	292.303,66	863,40	(212.438,18)
BKBR3	199.880,00	23.916,85	96,78	0,01%	69.747,00	212,02	(55.198,12)
BMGB4	176.700,00	10.727,47	1.486,36	0,19%	91.174,45	279,70	(72.629,94)
BRAP4	865.332,00	140.202,11	88.836,60	11,30%	(160.149,89)	(1.145,90)	671.707,27
BRDT3	2.963.459,65	157.364,66	36.186,91	4,60%	(88.065,40)	(1.390,17)	875.305,72
BRML3	2.276.980,51	223.584,94	(149.222,25)	-18,97%	1.586.216,81	4.733,59	(1.180.073,21)
CESP6	2.045.164,00	180.177,14	132.267,45	16,82%	458.796,97	1.268,25	(289.520,63)
CPFE3	2.299.056,00	100.599,49	(36.919,97)	-4,69%	1.565.839,56	4.686,80	(1.173.030,47)
CRFB3	1.181.178,00	61.484,27	(15.588,47)	-1,98%	806.489,96	2.413,16	(603.716,25)
CYRE COM-CPP ON	220.892,00	15.176,48	(6.552,82)	-0,83%	133.698,51	405,53	(103.386,94)
ELET6	1.232.720,00	138.234,65	(93.672,18)	-11,91%	656.489,15	2.010,71	(520.563,36)
ENG11	620.046,00	30.530,65	(16.653,77)	-2,12%	345.776,55	1.055,97	(272.035,31)
EQTL3	3.078.240,00	153.881,33	8.447,92	1,07%	902.588,41	2.677,39	(678.327,10)
EUCATEX PN	77.448,00	12.199,60	(7.518,46)	-0,96%	57.975,31	171,21	(42.112,61)
GMAT3	755.001,00	32.944,08	20.276,02	2,58%	312.455,90	960,34	(251.942,12)
GNDI3	424.000,00	18.090,83	8.347,58	1,06%	158.684,42	485,25	(126.977,91)
HAPV3	721.461,00	35.184,72	13.985,08	1,78%	291.281,94	894,47	(234.625,15)
HBSA3	406.455,00	53.376,38	17.039,36	2,17%	115.914,36	342,02	(86.075,00)
HGTX3	252.960,00	43.401,71	(25.743,75)	-3,27%	(47.588,27)	(339,74)	199.467,30
HYPE3	2.413.505,00	168.516,21	(11.212,12)	-1,43%	774.429,59	2.330,74	(600.618,88)
ITSA4	2.149.108,00	127.097,38	(73.037,17)	-9,29%	972.457,88	2.992,73	(783.752,09)
ITUB4	1.008.990,00	104.555,27	(75.938,33)	-9,66%	690.437,71	2.065,32	(516.498,33)
JBSS3	368.575,00	59.755,25	23.072,66	2,93%	25.114,74	(4,78)	33.906,24
LREN3	1.590.050,00	98.474,14	(37.362,60)	-4,75%	845.128,41	2.588,76	(670.348,87)
MDNE3	207.176,00	31.581,82	687,51	0,09%	100.237,27	308,21	(80.431,28)
MULT3	204.546,00	17.896,14	(9.025,04)	-1,15%	139.797,81	418,25	(104.617,71)
NTCO3	2.741.250,00	246.622,80	181.171,16	23,04%	(29.953,15)	(1.034,26)	690.196,91
OMGE3	986.076,00	50.334,97	26.644,86	3,39%	400.432,88	1.229,94	(322.639,21)
PARD3	692.997,40	50.540,08	(9.480,52)	-1,21%	360.180,41	1.104,57	(286.635,34)
PETR3	2.607.000,00	303.484,67	(142.863,14)	-18,17%	1.082.276,43	3.326,72	(872.752,30)
POWE3	121.800,00	8.981,61	6.559,75	0,83%	22.219,94	56,04	(10.634,32)
PRI03	697.935,00	49.806,29	24.674,39	3,14%	180.736,49	521,78	(127.485,21)
QUAL3	309.000,00	21.979,39	4.204,64	0,53%	162.355,22	497,63	(129.002,80)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	60.335.968,20	VAR / PL:	1,303%
VAR:	786.433,96	ETL / PL:	1,6345%
ETL:	986.220,25	VAR / CDI:	8077,24%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(36,58)	BAIXA 1:	36,70	Cenário 1:	19.808.458,10
				Cenário 2:	54.324,66
				Cenário 3:	(11.416.634,56)

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
RAIL3	1.845.640,44	247.020,75	87.010,77	11,06%	295.799,62	687,89	(104.073,64)
RECV3	427.571,00	72.998,31	27.857,67	3,54%	78.001,66	196,71	(37.331,09)
RENT3	3.652.369,05	343.606,22	218.377,21	27,77%	270.223,76	46,23	297.658,93
SEER3	498.888,00	112.839,73	(30.159,79)	-3,84%	180.034,09	548,98	(143.326,31)
SOMA3	145.665,00	29.357,23	14.464,39	1,84%	(27.641,56)	(197,11)	115.829,41
SULA11	2.285.544,59	219.634,82	18.676,73	2,37%	1.390.090,88	4.214,44	(1.073.702,23)
SUZB3	2.876.524,00	408.210,06	326.198,38	41,48%	742.742,35	2.142,69	(522.959,85)
TCSA3	160.035,00	23.854,83	(7.812,90)	-0,99%	130.896,75	380,86	(91.993,81)
TEND3	1.422.062,00	102.964,00	69.605,29	8,85%	625.980,84	1.926,28	(504.926,33)
TIMS3	155.084,00	10.345,61	814,64	0,10%	83.064,59	254,33	(65.806,66)
VALE3	2.664.620,00	224.472,14	104.170,48	13,25%	73.454,12	(521,44)	451.879,31
WEST3	45.500,00	3.180,24	2.309,51	0,29%	8.300,55	20,93	(3.972,59)
COMPROMISSADA	1.373.805,15	96.047,89	69.746,92	8,87%	250.658,61	613,40	(120.001,99)
Total	60.357.894,57	5.538.087,07	786.433,96	100,00%	19.808.458,10	54.324,66	(11.416.634,56)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FIA RVA EMB IV CNPJ - 38452613000132

Dados Gerais

PL:	61.071.738,42	VAR / PL:	4,826%
VAR:	2.947.157,03	ETL / PL:	6,0517%
ETL:	3.695.855,09	VAR / CDI:	29904,73%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(109,84)	BAIXA 1:	110,22	Cenário 1:	5.045.327,19
				Cenário 2:	13.598,03
				Cenário 3:	(1.585.959,12)

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%	-	-	-
RECEBER	819.558,59	-	-	0,00%	-	-	-
B3SA3	503.707,50	29.030,29	4.078,39	0,14%	51.738,95	192,05	(62.671,10)
UNT	2.400.256,32	228.233,50	164.873,01	5,59%	(251.124,44)	(1.033,92)	388.929,00
BID11	2.032.583,28	349.420,95	(39.372,23)	-1,34%	(1.047.672,68)	(5.733,18)	3.407.781,01
BID4	6.349,42	1.062,77	(49,86)	0,00%	(3.118,85)	(16,70)	9.554,72
BRML3	2.166.108,89	310.609,93	208.298,64	7,07%	1.113.817,46	3.506,53	(933.490,33)
CESP6	2.416.441,72	71.963,19	(30.472,51)	-1,03%	101.255,85	386,75	(131.101,23)
CLSA3	798.313,50	41.684,05	(17.716,43)	-0,60%	-	-	-
ELET3	2.322.545,75	422.309,74	390.746,94	13,26%	741.468,09	2.510,10	(728.676,10)
ELET6	654.193,15	116.488,17	107.419,48	3,64%	229.048,47	766,09	(219.140,78)
EQTL3	7.952.071,60	564.230,75	399.044,28	13,54%	880.978,26	3.258,02	(1.058.041,41)
ESPA3	1.422.778,50	182.001,78	125.959,68	4,27%	-	-	-
GGPS3	2.184.224,90	497.962,95	(32.132,03)	-1,09%	-	-	-
GMAT3	2.828.959,35	168.043,48	141.689,84	4,81%	654.673,79	2.296,83	(697.021,74)
GNDI3	1.641.760,00	120.032,74	99.332,96	3,37%	314.932,22	1.123,61	(348.326,47)
HAPV3	847.780,71	70.733,49	58.185,58	1,97%	187.621,73	661,05	(201.685,91)
LCAM3	1.178.006,75	72.292,94	24.050,81	0,82%	(139.561,71)	(578,99)	220.185,45
MATD3	1.192.116,84	221.408,08	(163.835,98)	-5,56%	-	-	-
MRVE3	371.836,20	31.367,05	28.214,13	0,96%	189.710,27	598,09	(159.481,19)
MULT3	804.314,10	101.063,38	62.456,77	2,12%	402.980,99	1.274,58	(341.152,49)
NTCO3	5.786.348,75	518.214,29	294.593,19	10,00%	(1.118.828,43)	(4.845,30)	1.962.101,73
OMGE3	840.548,52	51.482,00	35.803,47	1,21%	187.994,99	661,71	(201.635,30)
PETR4	6.492.521,88	1.088.443,15	989.457,88	33,57%	1.809.762,04	6.226,71	(1.844.110,62)
PRI03	2.400.182,40	223.059,96	174.349,16	5,92%	183.684,00	690,14	(228.859,50)
RAIL3	4.181.728,62	393.960,90	(151.523,18)	-5,14%	(92.668,63)	(365,33)	129.302,35
UGPA3	2.041.721,76	136.615,28	67.986,08	2,31%	740.591,05	2.465,01	(700.971,86)
VALE3	594.482,16	35.436,83	5.794,61	0,20%	(92.063,46)	(389,84)	152.719,25
COMPROMISSADA	4.125.374,45	92,47	(75,65)	0,00%	107,24	(55,99)	(166,61)
Total	61.007.815,61	6.047.244,11	2.947.157,03	100,00%	5.045.327,19	13.598,03	(1.585.959,12)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	101.630.775,30	VAR / PL:	6,933%
VAR:	7.045.918,48	ETL / PL:	8,6941%
ETL:	8.835.869,06	VAR / CDI:	42962,48%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	14,79	BAIXA 1:	(15,59)	Cenário 1:	18.688.107,21
				Cenário 2:	47.361,71
				Cenário 3:	(9.087.794,50)

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	5.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	89.379,57	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	3.332.992,00	534.973,36	488.350,51	6,93%	1.489.432,86	4.803,60	(1.315.441,14)
AMER3	900.395,80	256.950,12	182.246,74	2,59%	-	-	-
ASAI3	346.720,00	24.770,56	10.501,65	0,15%	-	-	-
AZUL4	587.390,00	132.716,36	124.568,97	1,77%	475.040,24	1.358,70	(324.858,47)
B3SA3	4.279.150,00	246.621,19	4.137,66	0,06%	439.538,27	1.631,51	(532.410,24)
UNT	1.480.556,00	140.781,83	97.769,11	1,39%	(154.901,71)	(637,75)	239.904,03
BBAS3	1.863.007,00	283.327,78	248.481,97	3,53%	860.765,34	2.760,80	(751.133,13)
BBDC3	1.187.168,50	162.255,10	148.463,38	2,11%	621.579,75	1.950,44	(517.258,78)
BBDC4	4.735.782,50	734.132,05	687.930,07	9,76%	2.602.308,63	8.092,52	(2.123.976,43)
BBSE3	660.333,00	82.286,21	74.748,52	1,06%	373.097,55	1.154,07	(301.053,61)
BEEF3	99.567,00	6.190,84	4.097,32	0,06%	25.401,21	88,24	(26.450,79)
BIDI11	887.250,00	152.526,95	(44.598,68)	-0,63%	(457.323,25)	(2.502,61)	1.487.542,35
BRAP4	761.788,00	82.158,64	(53.001,99)	-0,75%	(279.959,44)	(1.359,26)	657.843,52
BRDT3	1.515.655,00	117.835,28	88.162,79	1,25%	(321.541,39)	(1.408,31)	580.004,58
BRFS3	955.626,00	211.203,34	169.549,06	2,41%	466.442,85	1.482,10	(398.828,07)
BRKM5	704.550,00	88.407,24	53.010,05	0,75%	(134.987,49)	(583,98)	236.112,63
BRML3	388.161,00	55.660,48	44.087,30	0,63%	199.593,15	628,36	(167.279,00)
CCRO3	669.500,00	48.944,19	33.812,39	0,48%	52.053,65	195,46	(64.769,54)
CIEL3	173.056,00	29.608,54	25.154,92	0,36%	130.156,99	378,79	(92.293,14)
CMIG4	593.286,66	108.436,91	88.523,10	1,26%	344.238,43	1.059,30	(274.700,81)
COGN3	309.400,00	72.176,40	65.010,16	0,92%	245.815,46	706,12	(169.621,68)
CPFE3	217.752,00	19.028,73	16.560,73	0,24%	108.581,95	343,72	(92.090,14)
CPLE6	160.344,00	11.087,96	2.966,86	0,04%	24.598,54	89,25	(28.268,41)
CRFB3	341.820,00	37.591,42	34.873,69	0,49%	171.031,25	541,08	(144.864,68)
CSAN3	1.374.590,00	118.822,53	(1.134,08)	-0,02%	(205.872,93)	(869,23)	339.076,68
CSNA3	1.383.800,00	185.615,01	(20.839,19)	-0,30%	(224.566,58)	(954,98)	376.456,50
CVCB3	231.920,00	67.948,82	57.620,90	0,82%	124.194,62	388,09	(102.428,55)
CYRE3	268.965,00	25.188,24	21.641,15	0,31%	129.633,88	412,81	(111.370,50)
ECOR3	165.832,00	22.439,25	20.320,58	0,29%	99.352,09	303,79	(78.209,18)
EGIE3	443.781,00	19.395,48	17.157,50	0,24%	90.096,35	319,91	(98.568,83)
ELET3	664.125,00	120.758,20	116.572,05	1,65%	212.020,58	717,75	(208.362,75)
ELET6	454.160,00	80.869,49	78.063,11	1,11%	159.012,14	531,84	(152.133,93)
ENBR3	183.291,00	9.828,64	7.763,97	0,11%	53.310,01	182,53	(53.730,50)
ENEV3	944.804,00	85.578,28	56.895,67	0,81%	100.522,70	372,50	(121.288,01)
ENGI11	491.625,00	54.680,93	52.130,64	0,74%	184.473,93	611,08	(172.769,02)
EQTL3	1.127.720,00	80.016,17	59.870,25	0,85%	124.935,60	462,04	(150.045,74)
EZTC3	121.000,00	17.764,45	16.418,29	0,23%	94.571,68	272,74	(65.796,71)
FLRY3	327.040,00	31.631,46	29.275,15	0,42%	145.489,85	469,57	(128.700,02)
GGBR4	1.410.640,00	180.689,41	15.158,55	0,22%	210.958,52	766,68	(243.384,51)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	101.630.775,30	VAR / PL:	6,933%
VAR:	7.045.918,48	ETL / PL:	8,6941%
ETL:	8.835.869,06	VAR / CDI:	42962,48%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	14,79	BAIXA 1:	(15,59)	Cenário 1:	18.688.107,21
				Cenário 2:	47.361,71
				Cenário 3:	(9.087.794,50)

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
GNDI3	2.176.000,00	159.092,22	130.960,35	1,86%	417.413,33	1.489,25	(461.674,30)
GOAU4	454.575,00	47.003,66	6.768,84	0,10%	26.999,60	102,27	(34.280,00)
GOLL4	168.425,60	35.101,47	31.752,97	0,45%	178.216,23	474,62	(105.267,34)
HAPV3	828.186,00	69.098,63	56.128,99	0,80%	183.285,24	645,77	(197.024,35)
HGTX3	215.760,00	47.201,69	35.969,24	0,51%	(79.951,03)	(389,04)	188.971,81
HYPE3	673.785,00	54.271,48	31.468,17	0,45%	93.281,28	340,69	(108.848,51)
IGTA3	163.320,00	20.335,82	13.809,44	0,20%	42.371,13	146,94	(43.945,91)
IRBR3	327.168,00	22.396,01	13.288,78	0,19%	121.438,79	402,89	(114.122,41)
ITSA4	2.312.190,00	261.057,60	234.144,72	3,32%	624.439,26	2.156,06	(641.349,40)
ITUB4	6.620.550,00	1.041.435,14	895.888,83	12,72%	3.322.564,40	10.505,81	(2.810.997,40)
JBSS3	2.047.995,00	230.655,38	(127.051,99)	-1,80%	(234.064,58)	(968,80)	367.210,57
JHSF3	99.218,00	9.658,83	4.903,36	0,07%	14.581,55	53,05	(16.867,18)
KLBN11	1.037.104,00	83.139,11	(39.755,11)	-0,56%	(61.739,26)	(248,13)	90.207,94
LAME4	277.219,00	285.322,62	202.178,34	2,87%	2.952.311,54	2.666,37	(267.360,59)
LCAM3	405.131,00	24.862,43	7.116,99	0,10%	(47.996,99)	(199,12)	75.724,48
LREN3	1.680.910,00	195.419,07	175.641,22	2,49%	586.773,51	1.963,35	(561.894,79)
LWSA3	488.236,00	60.815,62	20.261,27	0,29%	(5.230,20)	(20,50)	7.198,20
MGLU3	2.523.500,00	284.619,45	(113.331,61)	-1,61%	(645.508,81)	(2.904,98)	1.246.690,54
MRFG3	333.370,00	24.516,16	(2.061,93)	-0,03%	(41.003,83)	(170,54)	65.088,35
MRVE3	193.590,00	16.330,70	14.312,16	0,20%	98.769,33	311,39	(83.031,08)
MULT3	263.855,00	33.153,81	24.717,78	0,35%	132.197,79	418,13	(111.914,97)
NTCO3	2.090.875,00	187.254,75	71.335,64	1,01%	(404.284,38)	(1.750,83)	708.997,96
PACUCAR_CBD ON ED	223.416,00	55.133,89	48.515,91	0,69%	131.244,43	402,88	(104.186,05)
PETR3	4.570.500,00	811.716,55	746.666,66	10,60%	1.063.613,61	3.729,52	(1.131.029,46)
PETR4	5.680.701,00	952.344,89	885.707,99	12,57%	1.583.470,52	5.448,13	(1.613.524,18)
PRI03	667.590,00	62.042,20	39.962,40	0,57%	51.090,12	191,96	(63.655,29)
QUAL3	334.750,00	37.088,56	28.961,35	0,41%	114.816,47	385,09	(110.526,11)
RADL3	1.249.380,00	131.977,82	25.286,90	0,36%	161.764,83	593,19	(190.516,45)
RAIL3	1.154.894,00	108.802,63	(33.742,12)	-0,48%	(25.592,87)	(100,90)	35.710,23
RENT3	1.696.695,00	102.161,93	(3.758,78)	-0,05%	(183.996,13)	(759,13)	286.414,31
SANB11	745.936,00	109.814,31	94.504,31	1,34%	379.234,24	1.196,35	(319.243,06)
SBSP3	556.722,00	28.085,31	7.684,48	0,11%	188.258,13	632,60	(181.982,82)
SULA11	392.083,00	54.382,87	41.558,95	0,59%	166.941,17	542,60	(149.959,95)
SUZB3	1.800.531,00	157.748,37	(98.065,61)	-1,39%	136.441,65	512,82	(170.137,60)
TAEE11	383.800,00	34.504,47	22.974,78	0,33%	70.779,23	253,33	(78.856,33)
TIMS3	419.972,00	31.922,35	18.708,45	0,27%	148.325,95	495,51	(141.538,72)
TOTS3	784.992,00	83.899,64	58.964,83	0,84%	(102.524,08)	(428,21)	164.438,47
UGPA3	885.768,00	59.268,33	36.187,54	0,51%	321.293,46	1.069,40	(304.105,32)
USIM5	485.452,00	68.775,02	(32.190,49)	-0,46%	(113.846,54)	(505,53)	212.564,72
VALE3	12.311.632,00	733.891,10	117.359,31	1,67%	(1.906.619,68)	(8.073,48)	3.162.791,66
VIVT3	848.926,00	72.525,64	60.565,22	0,86%	335.129,68	1.101,94	(308.786,63)
VVAR3	922.847,00	242.017,55	182.897,93	2,60%	281.458,93	958,23	(280.112,94)
WEGE3	2.428.280,00	237.416,30	(84.834,20)	-1,20%	(187.226,86)	(759,49)	279.739,46
YDUQ3	389.988,00	75.369,81	71.244,46	1,01%	220.110,93	680,99	(177.687,72)
COMPROMISSADA	475.957,89	10,67	(8,68)	0,00%	12,37	(6,46)	(19,22)
EMP AÇÃO PROVISÃO	(81.718,00)	10,30	(0,44)	0,00%	(31,57)	16,46	48,94
Total	101.548.980,52	12.184.550,00	7.045.918,48	100,00%	18.688.107,21	47.361,71	(9.087.794,50)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	19.415.510,00	VAR / PL:	6,920%
VAR:	1.343.628,05	ETL / PL:	8,6784%
ETL:	1.684.964,36	VAR / CDI:	42885,18%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(944,62)	BAIXA 1:	1.196,62	Cenário 1:	3.479.599,69
				Cenário 2:	8.813,60
				Cenário 3:	(1.695.370,36)

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	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(5.684,09)	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	620.672,00	99.623,10	90.940,10	6,77%	277.363,18	894,53	(244.962,33)
AMER3	166.940,00	47.640,44	33.790,87	2,51%	-	-	-
ASAI3	69.344,00	4.954,11	2.095,12	0,16%	-	-	-
AZUL4	108.920,00	24.609,66	23.101,46	1,72%	88.086,93	251,94	(60.238,66)
B3SA3	799.100,00	46.054,71	755,74	0,06%	82.080,56	304,67	(99.423,72)
UNT	260.414,00	24.762,02	17.173,46	1,28%	(27.245,56)	(112,17)	42.196,56
BBAS3	347.930,00	52.913,51	46.417,08	3,45%	160.754,14	515,60	(140.279,53)
BBDC3	220.955,00	30.198,81	27.635,50	2,06%	115.688,00	363,01	(96.271,85)
BBDC4	885.125,00	137.210,40	128.587,68	9,57%	486.375,47	1.512,50	(396.974,45)
BBSE3	123.946,00	15.445,31	14.033,88	1,04%	70.031,26	216,62	(56.508,45)
BEEF3	18.837,00	1.171,24	775,42	0,06%	4.805,63	16,69	(5.004,20)
BIDH11	163.254,00	28.064,96	(8.223,26)	-0,61%	(84.147,48)	(460,48)	273.707,79
BRAP4	140.524,00	15.155,48	(9.782,27)	-0,73%	(51.643,00)	(250,74)	121.349,78
BRDT3	283.300,00	22.025,29	16.469,80	1,23%	(60.101,19)	(263,24)	108.412,07
BRFS3	179.340,00	39.636,02	31.844,74	2,37%	87.536,19	278,14	(74.847,09)
BRKM5	132.825,00	16.666,94	9.987,62	0,74%	(25.448,46)	(110,09)	44.513,04
BRML3	72.216,00	10.355,44	8.203,06	0,61%	37.133,61	116,90	(31.121,68)
CCRO3	124.800,00	9.123,58	6.299,68	0,47%	9.703,20	36,44	(12.073,55)
CIEL3	32.110,00	5.493,77	4.667,05	0,35%	24.150,22	70,28	(17.124,70)
CMIG4	111.042,00	20.295,50	16.564,54	1,23%	64.429,10	198,26	(51.414,15)
COGN3	57.512,00	13.416,32	12.085,79	0,90%	45.692,76	131,26	(31.529,68)
CPFE3	40.512,00	3.540,23	3.082,01	0,23%	20.201,29	63,95	(17.133,05)
CPLB6	29.988,00	2.073,70	556,98	0,04%	4.600,49	16,69	(5.286,84)
CRFB3	64.566,00	7.100,60	6.589,10	0,49%	32.305,90	102,20	(27.363,33)
CSAN3	255.500,00	22.085,97	(181,15)	-0,01%	(38.266,34)	(161,57)	63.025,41
CSNA3	257.125,00	34.489,27	(3.899,66)	-0,29%	(41.726,90)	(177,45)	69.949,69
CVCB3	42.370,00	12.413,73	10.522,39	0,78%	22.689,40	70,90	(18.712,91)
CYRE3	50.040,00	4.686,18	4.028,24	0,30%	24.117,93	76,80	(20.720,09)
ECOR3	30.548,00	4.133,55	3.743,08	0,28%	18.301,70	55,96	(14.406,95)
EGIE3	83.446,00	3.647,01	3.228,12	0,24%	16.941,19	60,15	(18.534,31)
ELET3	124.775,00	22.687,91	21.895,89	1,63%	39.834,17	134,85	(39.146,94)
ELET6	85.155,00	15.163,03	14.633,52	1,09%	29.814,78	99,72	(28.525,11)
ENBR3	34.260,00	1.837,13	1.451,79	0,11%	9.964,49	34,12	(10.043,08)
ENEV3	176.122,00	15.952,75	10.610,32	0,79%	18.738,55	69,44	(22.609,44)
ENGI11	89.775,00	9.985,21	9.519,48	0,71%	33.686,54	111,59	(31.549,12)
EQTL3	210.540,00	14.938,64	11.172,93	0,83%	23.324,89	86,26	(28.012,83)
EZTC3	22.000,00	3.229,90	2.986,03	0,22%	17.194,85	49,59	(11.963,04)
FLRY3	60.736,00	5.874,41	5.435,69	0,40%	27.019,54	87,21	(23.901,43)
GGBR4	261.800,00	33.534,06	2.790,07	0,21%	39.151,69	142,29	(45.169,61)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	19.415.510,00	VAR / PL:	6,920%
VAR:	1.343.628,05	ETL / PL:	8,6784%
ETL:	1.684.964,36	VAR / CDI:	42885,18%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(944,62)	BAIXA 1:	1.196,62	Cenário 1:	3.479.599,69
				Cenário 2:	8.813,60
				Cenário 3:	(1.695.370,36)

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
GNDI3	408.000,00	29.829,79	24.551,54	1,83%	78.265,00	279,23	(86.563,93)
GOAU4	84.075,00	8.693,47	1.245,14	0,09%	4.993,66	18,91	(6.340,19)
GOLL4	30.900,00	6.439,85	5.823,04	0,43%	32.696,23	87,08	(19.312,75)
HAPV3	153.684,00	12.822,43	10.414,46	0,78%	34.011,69	119,83	(36.561,22)
HGTX3	40.920,00	8.952,04	6.815,33	0,51%	(15.163,13)	(73,78)	35.839,48
HYPE3	124.775,00	10.050,27	5.830,42	0,43%	17.274,31	63,09	(20.157,13)
IGTA3	28.581,00	3.558,77	2.415,71	0,18%	7.414,95	25,71	(7.690,53)
IRBR3	60.776,00	4.160,37	2.470,00	0,18%	22.558,94	74,84	(21.199,82)
ITSA4	432.279,00	48.806,42	43.796,67	3,26%	116.742,99	403,09	(119.904,45)
ITUB4	1.236.240,00	194.464,78	167.368,79	12,46%	620.414,77	1.961,72	(524.891,05)
JBSS3	381.395,00	42.954,60	(23.646,45)	-1,76%	(43.589,49)	(180,42)	68.385,07
JHSF3	18.650,00	1.815,57	921,93	0,07%	2.740,89	9,97	(3.170,52)
KLBN11	193.234,00	15.490,54	(7.408,90)	-0,55%	(11.503,30)	(46,23)	16.807,61
LAME4	51.757,00	53.269,95	37.726,67	2,81%	551.198,83	497,81	(49.916,43)
LCAM3	76.132,00	4.672,13	1.339,28	0,10%	(9.019,57)	(37,42)	14.230,10
LREN3	313.880,00	36.491,03	32.795,42	2,44%	109.569,50	366,62	(104.923,84)
LWSA3	92.167,00	11.480,50	3.830,09	0,29%	(987,33)	(3,87)	1.358,84
MGLU3	471.740,00	53.206,41	(21.143,59)	-1,57%	(120.670,63)	(543,05)	233.054,80
MRFG3	62.752,00	4.614,81	(388,11)	-0,03%	(7.718,37)	(32,10)	12.251,93
MRVE3	35.850,00	3.024,20	2.650,03	0,20%	18.290,62	57,66	(15.376,13)
MULT3	49.035,00	6.161,33	4.595,23	0,34%	24.567,73	77,71	(20.798,36)
NTCO3	387.000,00	34.658,98	13.216,55	0,98%	(74.828,98)	(324,06)	131.228,41
PACUCAR_CBD ON ED	40.339,00	9.954,73	8.755,26	0,65%	23.696,91	72,74	(18.811,37)
PETR3	852.500,00	151.403,21	139.275,00	10,37%	198.387,62	695,64	(210.962,17)
PETR4	1.052.181,00	176.393,58	164.032,33	12,21%	293.290,85	1.009,10	(298.857,39)
PRI03	123.165,00	11.446,29	7.370,96	0,55%	9.425,72	35,41	(11.743,89)
QUAL3	61.800,00	6.847,12	5.347,77	0,40%	21.196,89	71,09	(20.404,82)
RADL3	232.208,00	24.529,21	4.696,37	0,35%	30.065,38	110,25	(35.409,12)
RAIL3	214.864,00	20.242,35	(6.272,11)	-0,47%	(4.761,46)	(18,77)	6.643,76
RENT3	316.965,00	19.085,20	(695,09)	-0,05%	(34.372,90)	(141,81)	53.505,97
SANB11	125.674,00	18.501,32	15.928,93	1,19%	63.892,72	201,56	(53.785,52)
SBSP3	102.834,00	5.187,73	1.417,22	0,11%	34.773,79	116,85	(33.614,66)
SULA11	71.832,00	9.963,27	7.614,03	0,57%	30.584,64	99,41	(27.473,58)
SUZB3	335.234,00	29.370,57	(18.274,01)	-1,36%	25.403,55	95,48	(31.677,27)
TAEI1	72.200,00	6.490,94	4.321,64	0,32%	13.314,90	47,66	(14.834,36)
TIMS3	78.108,00	5.937,04	3.484,17	0,26%	27.586,23	92,16	(26.323,91)
TOTS3	144.976,00	15.494,98	10.889,83	0,81%	(18.934,63)	(79,08)	30.369,27
UGPA3	164.424,00	11.001,91	6.724,06	0,50%	59.641,30	198,51	(56.450,69)
USIM5	90.508,00	12.822,46	(6.010,93)	-0,45%	(21.225,63)	(94,25)	39.630,71
VALE3	2.283.960,00	136.145,88	21.632,17	1,61%	(353.701,53)	(1.497,73)	586.736,97
VIVT3	156.598,00	13.378,52	11.177,29	0,83%	61.820,04	203,27	(56.960,64)
VVAR3	172.483,00	45.233,84	34.190,85	2,54%	52.605,56	179,10	(52.353,99)
WEGE3	453.517,00	44.340,99	(15.784,03)	-1,17%	(34.967,37)	(141,85)	52.245,46
YDUQ3	73.476,00	14.200,11	13.423,08	1,00%	41.470,18	128,30	(33.477,40)
INDQ21	-	33.679,66	33.655,07	2,50%	-	-	-
COMPROMISSADA	341.069,48	7,65	(6,22)	0,00%	8,87	(4,63)	(13,77)
EMP AÇÃO PROVISÃO	30,49	0,01	0,00	0,00%	0,02	(0,01)	(0,04)
LFT	295.041,40	101,80	(72,75)	-0,01%	0,00	(0,00)	(0,00)
Total	19.431.489,28	2.299.568,46	1.343.628,05	100,00%	3.479.599,69	8.813,60	(1.695.370,36)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/07/2021

FIM EMB V A INVEST NO EXT CNPJ - 41252756000105

Dados Gerais

PL:	74.981.934,18	VAR / PL:	7,164%
VAR:	5.371.654,62	ETL / PL:	8,9839%
ETL:	6.736.273,91	VAR / CDI:	44394,42%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	8.143.415,67	BAIXA 1:	(6.576.624,07)	Cenário 1:	(7.895.140,03)
				Cenário 2:	(545.055,27)
				Cenário 3:	12.659.278,55

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	44.199,26	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(27.597,03)	-	-	0,00%	-	-	-
EWJ_US	3.046.489,52	258.826,46	255.020,78	4,75%	(396.326,57)	(27.418,41)	635.223,34
SPY	3.536.384,39	238.845,78	232.614,76	4,33%	(477.448,06)	(31.904,91)	770.420,38
VTV_US	4.999.672,12	424.766,75	418.521,15	7,79%	(650.421,71)	(44.997,05)	1.042.481,31
LFT	21.598,08	45,47	30,21	0,00%	0,00	-	(0,00)
AB AMERICAN GROWTH	7.587.711,98	852.271,02	801.886,53	14,93%	(987.107,25)	(68.289,41)	1.582.113,34
BTG MAS CASH FIR DI	15.057,02	17,98	14,73	0,00%	(238,43)	(0,94)	330,16
FUNDSMITH EQ FUND	9.837.850,27	930.541,33	910.387,42	16,95%	(1.279.834,21)	(88.540,65)	2.051.289,53
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.181.634,98	374.119,02	180.443,84	3,36%	-	-	-
JANUS H GL FICFIA IE	3.748.650,22	400.594,01	305.055,09	5,68%	-	-	-
LOOMIS US GROWTH	7.815.931,08	525.970,03	494.080,42	9,20%	(1.016.796,93)	(70.343,38)	1.629.699,29
EUROPEA	5.481.511,98	368.876,21	346.511,21	6,45%	(713.105,64)	(49.333,61)	1.142.949,71
PICTET GL FIC FIM IE	3.648.208,81	340.237,69	255.964,43	4,77%	-	-	-
RESEAR	8.635.869,97	431.696,58	275.552,87	5,13%	(1.123.465,14)	(77.722,83)	1.800.664,70
QUAL	9.611.564,92	923.523,33	895.571,19	16,67%	(1.250.396,09)	(86.504,08)	2.004.106,79
Total	72.184.737,59	6.070.331,65	5.371.654,62	100,00%	(7.895.140,03)	(545.055,27)	12.659.278,55



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

30/07/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB II	20/10/14	15/01/23	SABESP	1.083.208,72	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	21/10/14	15/01/23	SABESP	5.410.408,69	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	24/02/15	15/01/23	SABESP	2.777.340,72	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	04/03/15	02/03/22	B VOTORA	23.065.474,42	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.046.193,74	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.045.241,48	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.150.016,76	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/06/15	15/04/23	RD COLIN	1.348.597,77	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	09/06/15	07/06/22	B VOTORA	10.717.792,42	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB II	30/06/15	28/06/22	B VOTORA	10.758.817,80	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	12/08/15	16/07/23	DUKE GEP	2.531.470,83	-	Aaa.br	-
FI RF EMB II	06/11/15	04/11/22	BRADESCO	6.499.170,11	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	18/11/15	16/11/22	BRADESCO	16.151.170,96	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/04/22	ECPT	15.638,55	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/07/22	ECPT	15.236,04	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/10/22	ECPT	48.025,06	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/01/23	ECPT	46.781,21	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	11/02/16	15/01/23	ECPT	163.087,65	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/07/22	ECPT	133.298,51	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/10/22	ECPT	419.232,04	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/04/22	ECPT	62.781,09	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/04/22	ECPT	73.780,08	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/01/23	ECPT	784.580,11	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/24	TRANS AL	2.185.328,01	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	806.607,72	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	483.964,63	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/24	TRANS AL	1.611.007,65	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	28/07/16	04/10/21	B VOTORA	2.267.909,19	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	411.829,40	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	264.885,88	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/09/16	15/10/22	ECPT	1.120.415,13	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	10/10/16	15/01/23	SABESP	213.606,31	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FIM EMB II A	12/12/16	12/01/22	LOCALIZA	533.013,90	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	12/12/16	12/01/22	LOCALIZA	603.411,96	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.123.945,81	brAAA	-	-
FIM EMB II A	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.518.845,69	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/04/22	ECPT	267.300,81	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/07/22	ECPT	262.696,77	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/10/22	ECPT	815.393,93	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/01/23	ECPT	384.672,85	-	A2.br	-
FIM EMB I A	28/04/17	15/04/22	LAME	459.447,45	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/01/23	ECPT	724.437,72	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/07/22	ECPT	16.820,88	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/17	15/04/23	RD COLIN	2.490.738,29	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	25/08/17	15/08/24	PETR	16.406.215,74	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FIM EMB II A	22/09/17	15/09/22	ENERSUL	537.763,74	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	28/09/17	25/09/21	NATURA	632.260,90	brAA+	-	AA(bra)
FIM EMB II A	28/09/17	25/09/21	NATURA	1.121.753,21	brAA+	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/11/27	RB CAPIT	4.066.762,12	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/11/27	RB CAPIT	1.186.859,88	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/11/27	RB CAPIT	4.240.946,98	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	29/01/18	27/10/22	SUL AME	1.302.057,59	-	-	A+(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	15/02/25	SABESP	8.278.862,07	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.137.938,30	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	11.306.155,19	brAA	-	-
FI RF EMB II	23/05/18	15/05/28	COMGAS	25.151.893,55	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	555.991,63	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	555.991,63	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	555.991,63	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	554.547,52	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	555.991,63	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	10.489.798,78	-	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	12.098.995,53	brA	Aa1.br	-
FI RF EMB II	26/07/18	15/07/25	CSMG	13.580.800,87	-	Aa3.br	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/07/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/22	CEMIG G	1.480.471,86	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/22	CEMIG G	71.616,80	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/22	CEMIG G	502.491,64	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	777.437,02	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	441.248,04	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	1.166.155,54	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/25	CEMIG	2.261.656,79	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB II A	15/08/18	15/08/21	SABEREDU	254.208,31	-	-	AA+(bra)
FIM EMB I A	15/08/18	15/08/21	SABEREDU	681.278,27	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	14/11/18	15/03/24	BRADESCO	283.479,43	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	14/11/18	15/03/24	BRADESCO	283.479,43	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	04/01/19	07/06/24	MOV_PART	1.160.573,11	-	-	AA-(bra)
FIM EMB II A	17/01/19	16/09/24	ITAUUBB	278.811,90	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	17/01/19	16/09/24	ITAUUBB	557.623,81	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	2.420.297,33	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	2.420.297,33	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	19/08/20	14/08/24	B3SA	1.694.675,39	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	491.957,47	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	3.114.942,29	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	1.773.885,13	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	5.363.046,05	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	605.755,16	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	4.901.110,01	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	7.269.062,03	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	748.933,66	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	538.078,48	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	22/09/25	BCBF	261.224,17	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	08/01/21	15/04/24	ECORODOV	1.331.632,94	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	20/01/21	15/07/23	AEGEA SA	568.811,14	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	20/01/21	23/07/23	COPEL GT	171.240,93	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	04/02/21	15/07/23	AEGEA SA	192.274,19	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	05/02/21	23/07/23	COPEL GT	107.621,50	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/23	AEGEA SA	264.377,01	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/24	COPEL GT	279.172,50	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	22/08/22	ITAU	4.689.043,22	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	5.537.637,34	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	5.552.386,63	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.588.279,42	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	501.098,68	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	4.981.170,98	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	1.485.890,97	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	2.847.920,56	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.046.990,62	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/07/34	IGUA SAN	2.333.423,33	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/28	COMGAS	21.906.487,93	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	8.816.841,38	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	742.028,94	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	742.028,94	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	5.936.231,56	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	3.710.144,72	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	5.194.202,61	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	588.734,71	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	147.183,68	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	1.050.891,46	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	16/07/23	DUKE GEP	10.281.897,63	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	826.409,41	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	149.538,62	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.454.480,55	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	1.071.497,18	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.652.818,81	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	826.409,41	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECPT	498.491,36	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/22	ECPT	126.150,75	-	A2.br	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/07/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.011.525,11	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/11/22	ITAU	7.434.443,87	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	3.383.856,36	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	1.128.735,95	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/22	SUL AME	1.501.724,90	-	-	A+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	1.411.298,94	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	848.150,76	brAAA	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	2.460.785,57	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	27/01/25	BRADESCO	10.529.627,75	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	CCR	5.396.934,31	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	ECORODOV	3.701.623,93	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/25	SABESP	1.206.655,31	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/28	COMGAS	9.736.216,86	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	JAGUARA	1.740.603,84	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	ENERGMIR	1.048.744,59	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	01/08/25	BRADESCO	3.438.243,60	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/24	SONAE	356.602,12	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/24	SONAE	416.035,81	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/24	SONAE	416.035,81	-	-	AA+(bra)
FIM EMB I A	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	960.958,93	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	576.727,12	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	142.159,19	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.081.502,50	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	436.879,46	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	3.339.679,73	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	655.390,52	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	601.315,39	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	1.346.467,12	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	1.599.579,82	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	3.350.564,95	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	657.630,72	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	603.309,73	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.341.063,11	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/09/34	BRKA	4.631.515,19	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	3.789.619,85	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/36	PAMPASUL	113.013,33	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/38	TAUBATE	8.723.156,81	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/26	IRB	5.702.374,16	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	972.008,94	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.515.831,77	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/35	MS 306	783.548,83	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/29	ANET	2.839.140,73	brA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/29	CAGECE	2.423.223,48	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/28	BRISANET	3.192.392,45	brA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/36	PAMPASUL	1.018.353,23	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/27	GETI	1.981.288,44	-	Aa1.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	827.824,12	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	1.852.749,22	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/24	AMPL	537.389,42	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/02/23	GETI	4.041.978,64	-	Aa1.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/24	AMPL	2.587.430,54	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	1.166.837,81	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	851.476,24	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	455.629,19	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.296.092,28	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/31	LOCALIZA	8.196.668,94	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/30	NORTE EN	2.007.252,57	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.594.134,69	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	15/11/25	QUATA	4.290.206,10	-	-	A-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	15/12/35	MS 306	2.427.956,63	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	CO SAN LO	1.010.395,80	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	20/08/26	VAMOS	507.191,40	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	423.617,73	-	-	AAA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/07/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	808.316,64	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	503.816,76	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	503.816,76	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	20/08/26	VAMOS	1.044.037,14	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	499.331,08	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	1.014.900,56	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	999.677,05	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	1.720.508,90	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	429.626,50	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	202.079,16	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	505.732,50	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	1.510.413,62	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	19/06/24	BNBBM	533.835,98	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	12/06/24	BNBBM	807.587,15	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	728.166,52	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	1.743.497,29	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/09/25	BRKA	1.890.312,39	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/09/25	BRKA	628.329,19	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	25/04/23	CELPA	2.517.357,19	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/12/30	B2W	3.269.508,01	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/09/34	BRKA	998.218,92	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/10/36	PAMPASUL	3.849.987,59	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	13/07/23	ECORODOV	2.060.707,64	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	15/05/23	LIGHT	2.049.850,20	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	15/03/29	OMEGA GE	2.056.591,33	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	20/04/26	SMARTIFI	2.060.488,48	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	30/09/23	USIMINAS	2.043.786,93	brAA+	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	30/09/23	USIMINAS	510.946,73	brAA+	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/31	CORSAN	1.531.215,77	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/26	CORSAN	1.032.417,35	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	15/12/30	MG050	488.584,57	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/06/21	15/04/28	PAMPASUL	1.320.284,33	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/06/21	15/06/31	RIO PR	503.999,88	-	Aaa.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	27/11/25	GUAR	2.025.152,99	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAME	297.677,74	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	1.548.292,48	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAME	1.543.064,19	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	84.623,27	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	20/06/26	OURO VER	2.017.090,94	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/06/21	15/09/34	BRKA	1.687.596,63	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/06/21	27/11/25	GUAR	1.343.213,72	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	15/12/35	MS 306	3.134.195,30	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/10/26	LIGHT	5.073.016,31	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/12/35	MS 306	2.741.376,16	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	1.125.767,21	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	238.083,86	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/03/29	CAGECE	1.739.936,86	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/07/28	VENSJOR	279.699,58	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/07/28	VENSJOR	1.349.401,68	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	253.235,66	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	250.936,95	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/03/29	CAGECE	2.590.665,10	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	4.978.907,68	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	31/10/22	ITAU	1.291.080,85	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	15/02/23	GETI	3.058.243,61	-	Aa1.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	15/12/22	COELCE	3.009.806,23	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	3.012.735,94	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/07/29	GUARIROB	1.139.330,26	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	1.861.782,61	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	219.545,01	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/05/26	OMEGA GE	292.362,72	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	904.294,41	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.696.245,82	brAAA	-	AAA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/07/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/09/34	BRKA	456.643,79	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	470.233,09	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/05/26	OMEGA GE	861.284,78	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.496.687,49	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	2.195.141,65	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.097.570,82	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/09/34	BRKA	762.175,99	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	1.847.206,28	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	288.761,17	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	3.723.565,21	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/03/29	ANET	1.051.533,60	brA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	11/03/25	BRML	3.011.687,57	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	10/05/24	MULTIPLA	3.013.677,26	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	364.998,86	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	364.998,86	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	1.301.300,27	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/07/27	RT BANDE	2.236.823,40	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/05/23	ELEKTRO	954.015,58	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/05/23	ELEKTRO	2.081.307,48	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/09/23	SONAE	3.008.289,86	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	15/02/31	CORSAN	2.756.188,39	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	19/07/21	15/07/30	PARANAGU	717.732,93	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/05/30	NORTE EN	1.822.828,06	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/10/30	LAME	1.965.888,08	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	20/07/21	15/11/28	CTEEP	999.750,14	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	1.967.387,86	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	720.913,42	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/05/25	INTERVIA	1.260.775,48	-	-	-
FIM EMB I A	21/07/21	05/03/24	ENERG TR	1.295.171,81	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/01/25	LIGHT	1.119.686,82	brAA+	Ba3	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/01/26	AERIS	1.184.707,18	brAA	-	AA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/07/27	RT BANDE	1.075.290,90	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/29	OMEGA GE	1.039.606,92	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/08/26	VAMOS	1.043.014,58	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	15/12/30	MG050	1.465.753,72	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/07/21	15/03/29	ANET	2.628.834,01	brA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	509.070,38	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.302.739,16	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	1.402.883,42	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	3.563.853,27	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/10/24	BKBR	1.392.466,24	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/12/26	RD COLIN	2.102.836,26	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/07/21	15/05/30	NORTE EN	1.011.360,22	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SN5	700.163,89	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SN3	6.136.393,23	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SN6	1.400.354,99	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC	3.642.242,52	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CELG DIST SN B	3.939.140,81	-	-	AA-sf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CREDZ SN4	14.192,65	brAA(sf)	-	Asf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CREDZ SN6	418.332,95	brAA(sf)	-	A+sf(bra)

Observação: Em julho de 2021, 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 2021.



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 **3.769.136.852,56**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.709.322.667,99	3.769.136.852,56	71,88%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou d	100,00%	2.027.616.668,29	3.769.136.852,56	53,80%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	681.705.999,70	3.015.309.526,98	18,09%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	753.827.381,74	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	ar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	376.913.690,87	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	erificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	942.284.213,14	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	erificar Rel. de Diversificação Debêntures	942.284.213,14	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	813.103.513,91	2.638.395.751,86	21,57%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	942.284.213,14	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	101.899.611,27	753.827.381,74	2,70%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	31.184.610,01	565.370.550,35	0,83%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	753.827.381,74	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	119.100.206,31	376.913.690,87	3,16%	Enquadrado

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



6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO												
Cliente: EMBRAER PREV Período: 01 DE JULHO DE 2021 À 31 DE JULHO DE 2021											 Bradesco	
FIM EMB I A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,4910%	2,4134%	2,1593%	3,5230%	0,0776%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5310%	3,4600%	3,1000%	4,5070%	0,0710%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5310%	3,4600%	3,1000%	4,5070%	0,0710%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5310%	3,4600%	3,1000%	4,5070%	0,0710%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5310%	3,4600%	3,1000%	4,5070%	0,0710%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5310%	3,4600%	3,1000%	4,5070%	0,0710%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5310%	3,4600%	3,1000%	4,5070%	0,0710%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5310%	3,4600%	3,1000%	4,5070%	0,0710%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5310%	3,4600%	3,1000%	4,5070%	0,0710%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5310%	3,4600%	3,1000%	4,5070%	0,0710%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5310%	3,4600%	3,1000%	4,5070%	0,0710%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5310%	3,4600%	3,1000%	4,5070%	0,0710%	NÃO
02/07/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5310%	3,4600%	3,1000%	4,5070%	0,0710%	NÃO



RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE JULHO DE 2021 À 31 DE JULHO DE 2021



FIM EMB II A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2022	Compra	1,7491%	1,7521%	1,3966%	2,7725%	-0,0030%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2023	Compra	2,4690%	2,4920%	2,1321%	3,4954%	-0,0230%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Compra	3,2590%	3,3000%	2,8730%	4,2806%	-0,0410%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,4690%	3,5147%	3,0605%	4,4674%	-0,0457%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	3,7090%	3,7335%	3,2785%	4,6273%	-0,0245%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2028	Compra	3,9090%	3,9431%	3,5119%	4,7224%	-0,0341%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2028	Compra	3,9090%	3,9431%	3,5119%	4,7224%	-0,0341%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2028	Compra	3,9190%	3,9431%	3,5119%	4,7224%	-0,0241%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2028	Compra	3,9190%	3,9431%	3,5119%	4,7224%	-0,0241%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2030	Compra	4,0320%	4,0500%	3,6538%	4,7443%	-0,0180%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/05/2035	Compra	4,0695%	4,0959%	3,7116%	4,6641%	-0,0264%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2040	Compra	4,2668%	4,2791%	3,8942%	4,8512%	-0,0123%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/05/2045	Compra	4,3395%	4,3638%	3,9939%	4,9202%	-0,0243%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	4,3700%	4,3876%	4,0203%	4,9238%	-0,0176%	NÃO
01/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2055	Compra	4,4040%	4,4300%	4,0668%	4,9562%	-0,0260%	NÃO
07/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Venda	1,6706%	1,6871%	1,3099%	2,6847%	-0,0165%	NÃO
07/07/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,5410%	2,5200%	2,2066%	3,5713%	0,0210%	NÃO
07/07/2021	FIM EMB II A	BNP	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2024	Venda	3,3510%	3,3022%	2,9512%	4,3583%	0,0488%	NÃO
07/07/2021	FIM EMB II A	BNP	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2024	Venda	3,3310%	3,3022%	2,9512%	4,3583%	0,0288%	NÃO
07/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5415%	3,5034%	3,1263%	4,5334%	0,0381%	NÃO
07/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	3,7515%	3,7028%	3,3250%	4,6747%	0,0487%	NÃO
15/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Venda	1,6396%	1,6700%	1,2800%	2,6532%	-0,0304%	NÃO
15/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Venda	1,6396%	1,6700%	1,2800%	2,6532%	-0,0304%	NÃO
15/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Venda	1,6396%	1,6700%	1,2800%	2,6532%	-0,0304%	NÃO
15/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,6410%	2,6333%	2,2971%	3,6642%	0,0077%	NÃO
15/07/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2024	Venda	3,3510%	3,3200%	2,9619%	4,3685%	0,0310%	NÃO
15/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,5065%	3,4891%	3,0923%	4,4999%	0,0174%	NÃO
15/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	3,6845%	3,6705%	3,2577%	4,6091%	0,0140%	NÃO
16/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Venda	1,6810%	1,6600%	1,3115%	2,6846%	0,0210%	NÃO
16/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,6410%	2,5700%	2,2962%	3,6636%	0,0710%	NÃO
16/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Venda	3,3410%	3,2636%	2,9356%	4,3421%	0,0774%	NÃO
16/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,4910%	3,4257%	3,0755%	4,4833%	0,0653%	NÃO
16/07/2021	FIM EMB II A	BNP	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2026	Compra	3,6663%	3,6198%	3,2442%	4,5959%	0,0465%	NÃO
19/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Compra	3,2635%	3,2500%	2,8794%	4,2858%	0,0135%	NÃO
19/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	3,6195%	3,6400%	3,1935%	4,5454%	-0,0205%	NÃO
19/07/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	4,3098%	4,3072%	3,9428%	4,8462%	0,0026%	NÃO



RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO												
Cliente: EMBRAER PREV Período: 01 DE JULHO DE 2021 À 31 DE JULHO DE 2021												
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
01/07/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,4405%	4,3876%	4,0203%	4,9238%	0,0529%	NÃO
01/07/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/05/2055	Venda	4,4705%	4,4300%	4,0668%	4,9562%	0,0405%	NÃO
20/07/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	MODAL	NTN-B	15/08/2040	Compra	4,2327%	4,1902%	3,8629%	4,8207%	0,0425%	NÃO
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
21/07/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2022	Compra	0,0912%	0,0856%	0,0447%	0,1734%	0,0056%	NÃO
FIM EMB VI A CRED PRIV												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
05/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2023	Compra	2,4090%	2,4372%	2,0802%	3,4443%	-0,0282%	NÃO
05/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2023	Compra	2,4390%	2,4372%	2,0802%	3,4443%	0,0018%	NÃO
05/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,4600%	3,4700%	3,0454%	4,4524%	-0,0100%	NÃO
05/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2028	Compra	3,9100%	3,9062%	3,5018%	4,7128%	0,0038%	NÃO
06/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2022	Compra	1,6100%	1,6700%	1,2499%	2,6249%	-0,0600%	NÃO
07/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TERRA	NTN-B	15/05/2023	Compra	2,5290%	2,5200%	2,2066%	3,5713%	0,0090%	NÃO
07/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/08/2024	Compra	3,3190%	3,3022%	2,9512%	4,3583%	0,0168%	NÃO
07/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/08/2028	Compra	3,9690%	3,9000%	3,5451%	4,7568%	0,0690%	NÃO
07/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	HENCORP	NTN-B	15/05/2055	Compra	4,4440%	4,3857%	4,0604%	4,9506%	0,0583%	NÃO
07/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	HENCORP	NTN-B	15/05/2055	Compra	4,4440%	4,3857%	4,0604%	4,9506%	0,0583%	NÃO
08/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TERRA	NTN-B	15/05/2055	Venda	4,4110%	4,3956%	4,0201%	4,9098%	0,0154%	NÃO
08/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TERRA	NTN-B	15/05/2055	Venda	4,4110%	4,3956%	4,0201%	4,9098%	0,0154%	NÃO
14/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2028	Compra	4,0300%	3,9197%	3,5963%	4,8095%	0,1103%	NÃO
16/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TERRA	NTN-B	15/08/2026	Compra	3,6763%	3,6198%	3,2442%	4,5959%	0,0565%	NÃO
16/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TERRA	NTN-B	15/05/2055	Venda	4,3803%	4,3572%	4,0166%	4,9063%	0,0231%	NÃO
19/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2022	Venda	1,6701%	1,6233%	1,3014%	2,6742%	0,0468%	NÃO
19/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TERRA	NTN-B	15/08/2026	Compra	3,6190%	3,6400%	3,1935%	4,5454%	-0,0210%	NÃO
27/07/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2028	Compra	3,9890%	4,0600%	3,5774%	4,7933%	-0,0710%	NÃO

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.