



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Junho/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: 30/06/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.716.976.851,04	VAR / PL:	2,529%
VAR:	94.003.470,63	ETL / PL:	3,1715%
ETL:	117.884.185,03	VAR / CDI:	15672,24%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	255.430.530,38	BAIXA 1:	268.433.316,24	Cenário 1:	324.702.385,21
				Cenário 2:	- 69.637.604,42
				Cenário 3:	-497.007.510,32

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	144.808,02	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	7.239.180,31	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	25.259.047,45	3.311.985,65	2.078.635,33	2,21%	8.147.333,34	27.545,30	7.983.583,85
ALSO3	1.179.159,00	125.975,48	76.531,40	0,08%	316.697,91	1.094,16	325.716,86
ANIM3	771.028,80	68.094,17	10.691,23	0,01%	161.811,69	572,88	175.860,67
ASAI3	8.784.298,78	955.743,48	393.460,60	-0,42%	-	-	-
AZUL4	672.403,00	116.069,30	97.511,41	0,10%	251.079,12	832,29	235.510,15
B3SA3	33.561.404,64	1.830.521,85	128.219,53	-0,14%	1.588.200,23	6.342,54	2.285.390,91
UNT	22.879.623,60	2.463.251,59	830.481,70	0,88%	3.479.255,22	12.630,47	4.003.778,31
BBAS3	14.687.547,00	1.989.604,61	1.666.420,97	1,77%	4.683.008,51	15.855,96	4.603.859,10
BBDC3	1.277.736,90	117.629,92	66.190,18	0,07%	272.258,16	962,59	294.982,64
BBDC4	39.541.004,10	3.746.614,81	2.289.290,57	2,44%	10.165.347,31	35.285,95	10.566.113,78
BBRK3	26.680,00	11.321,78	896,78	0,00%	424,99	1,67	588,56
BBSE3	1.065.926,00	117.048,68	94.256,73	0,10%	151.616,32	552,81	176.231,06
BEEF3	104.895,00	10.690,67	3.506,07	0,00%	634,40	2,48	868,27
BIDI11	9.372.275,52	1.801.264,33	852.685,13	-0,91%	189.186,93	745,09	263.348,09
BIDI12	11.000,67	3.184,35	197,36	0,00%	188,16	0,73	250,63
BKBR3	230.090,00	26.751,48	12.318,25	0,01%	53.793,98	188,54	57.145,19
BLCP11	1.526.877,30	1.004,09	449,75	0,00%	-	-	-
BMGB4	186.200,00	23.055,20	15.944,48	0,02%	31.953,73	115,01	36.055,10
BMLC11	1.528.011,88	86.244,38	4.530,59	0,00%	58.322,09	-	82.980,76
BPAN4	2.870.208,00	639.512,36	285.141,40	0,30%	1.662.197,05	5.116,89	1.327.488,48
BPML11	1.276.418,29	82.994,64	16.494,83	0,02%	92.657,39	374,97	137.643,73
BRAP4	6.313.698,00	787.726,54	420.264,08	-0,45%	278.378,75	1.109,86	398.980,99
BRDT3	4.313.331,50	312.520,53	137.322,13	0,15%	1.117.095,64	3.874,63	1.159.095,39
BRFS3	787.392,00	229.662,72	167.869,70	0,18%	552.996,03	1.634,78	405.243,98
BRKM5	504.220,00	94.751,24	40.963,42	-0,04%	102.472,29	363,82	112.085,81
BRML3	4.611.835,80	562.600,95	82.537,38	0,09%	811.736,47	2.915,99	911.922,09
BTLG11	237.120,80	9.766,12	1.390,23	0,00%	2.952,57	11,58	4.072,00
BTLG13	34.084,80	1.405,38	195,89	0,00%	837,71	-	1.172,30
BTLG14	924.604,10	-	-	0,00%	-	-	-
BTOW3	1.708.224,00	501.624,49	274.176,48	0,29%	369.275,00	1.303,89	398.909,91
CBOP11	36.944,28	2.059,67	833,65	0,00%	2.264,57	8,57	2.869,15
CCRO3	5.918.896,00	593.260,53	65.404,95	0,07%	695.621,77	2.564,66	829.530,12
CEAB3	14.751,80	1.390,86	1.024,62	0,00%	4.508,30	15,34	4.484,26
CEOC11	551.684,00	12.992,80	6.369,69	-0,01%	20.134,29	79,96	28.588,31



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.716.976.851,04	VAR / PL:	2,529%
VAR:	94.003.470,63	ETL / PL:	3,1715%
ETL:	117.884.185,03	VAR / CDI:	15672,24%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	255.430.530,38	BAIXA 1:	268.433.316,24	Cenário 1:	324.702.385,21
				Cenário 2:	- 69.637.604,42
				Cenário 3:	- 497.007.510,32

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
CESP6	10.671.947,37	435.856,16 -	196.184,13	-0,21%	- 708.179,75 -	2.856,44	1.043.696,33
CIEL3	4.080.804,00	786.122,41	364.005,92	0,39%	1.011.720,06	3.525,18 -	1.060.596,05
CJCT11	2.114.662,60	107.681,98 -	73.783,53	-0,08%	- 130.171,79 -	523,72	190.681,80
CMIG4	613.365,03	95.024,97	25.307,20	0,03%	119.752,29	426,63 -	132.009,22
CNES11	647.721,36	44.279,15	32.610,21	0,03%	- 4.212,74 -	16,48	5.768,92
CNRD11	64.914,50	-	-	0,00%	-	-	-
COGN3	3.378.433,15	538.495,45	400.298,99	0,43%	1.187.548,09	3.969,82 -	1.134.831,17
CPFE3	8.354.055,00	657.447,81	369.113,34	0,39%	674.360,99	2.528,76 -	836.387,76
CPLB6	156.288,00	15.166,75	2.220,87	0,00%	14.482,68	54,01 -	17.732,18
CRFB3	1.768.140,00	196.540,35	29.714,09	0,03%	227.288,81	833,82 -	267.944,58
CSAN3	1.294.296,00	159.100,78	102.197,20	0,11%	347.437,90	1.200,43 -	357.378,69
CSED3	5.868.570,00	602.406,28	132.339,83	0,14%	-	-	-
CSNA3	13.478.504,00	3.477.742,28 -	2.060.193,82	-2,19%	- 2.075.096,75 -	8.782,33	3.437.872,52
CVCB1	9.978,90	2.548,51	91,93	0,00%	- 405,23 -	1,61	578,29
CVCB3	293.055,00	30.945,26 -	715,13	0,00%	79.175,32	273,36 -	81.311,37
CYRE COM-CPP ON	232.064,00	16.918,79	926,72	0,00%	11.199,73	42,65 -	14.397,46
CYRE3	298.610,00	31.762,02	23.197,28	0,02%	38.280,81	140,46 -	45.144,60
ECOR3	95.120,00	7.999,08	4.019,26	0,00%	13.378,52	48,81 -	15.575,88
EBM	1.323.075,30	63.097,06	17.606,86	0,02%	- 39.000,59 -	11.578,17	54.903,26
EGIE3	467.044,00	22.117,52	14.923,18	0,02%	24.612,14	93,52 -	31.482,62
ELET3	3.251.575,46	342.892,03	198.368,59	0,21%	1.190.275,13	3.956,69 -	1.123.418,51
ELBET6	11.191.816,01	1.034.117,98	564.382,29	0,60%	3.729.657,02	12.556,71 -	3.620.716,50
ENBR3	99.012,00	5.466,16 -	440,02	0,00%	2.049,18	7,91 -	2.718,19
ENEV3	989.576,00	138.007,87	100.016,41	0,11%	240.142,01	838,56 -	252.981,67
ENGI11	1.564.301,76	122.613,65	101.437,88	0,11%	248.199,13	898,40 -	283.716,52
EQTL3	12.424.950,00	1.206.144,55 -	345.012,91	-0,37%	507.640,02	1.939,90 -	658.045,50
ESPA3	1.248.009,48	220.573,63	174.555,25	0,19%	-	-	-
EUCATEX PN	84.588,00	22.325,98 -	10.867,85	-0,01%	- 3.961,14 -	15,81	5.696,52
EVEN3	25.800,00	2.701,56	2.124,37	0,00%	5.616,19	19,82 -	6.058,15
EWJ_US	1.455.865,36	73.018,53 -	36.475,30	-0,04%	- 131.108,68 -	13.102,79	199.202,54
EZTC3	137.984,00	15.059,34	7.573,02	0,01%	15.772,71	58,24 -	18.872,63
FIGS11	454.790,00	46.728,88	30.586,93	0,03%	53.853,49	198,47 -	64.160,61
FLRY3	190.675,00	11.004,50	3.982,11	0,00%	9.783,95	37,20 -	12.534,54
GGBR4	1.388.934,00	339.230,61 -	205.505,44	-0,22%	- 210.958,10 -	891,77	348.483,97
GGPS3	2.016.207,60	733.214,22	204.227,02	0,22%	-	-	-
GMAT3	3.879.651,60	228.259,85	96.007,61	0,10%	118.876,65	456,53 -	155.897,12



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.716.976.851,04	VAR / PL:	2,529%
VAR:	94.003.470,63	ETL / PL:	3,1715%
ETL:	117.884.185,03	VAR / CDI:	15672,24%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	255.430.530,38	BAIXA 1:	268.433.316,24	Cenário 1:	324.702.385,21
				Cenário 2:	- 69.637.604,42
				Cenário 3:	- 497.007.510,32

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
GNDI3	14.904.087,00	1.113.743,83	801.009,18	0,85%	1.233.276,23	4.620,24	1.526.234,42
GOAU4	449.920,00	93.070,60	59.246,36	-0,06%	52.109,98	215,87	81.920,58
GOLL4	4.092.634,52	647.945,18	105.253,93	0,11%	415.534,25	1.543,25	503.968,77
GUAR3	8.317,38	772,98	390,59	0,00%	3.284,21	10,80	3.025,82
HAPV3	20.519.881,20	1.714.139,28	1.311.283,74	1,39%	1.957.138,25	7.289,23	2.389.308,21
HBRH11	1.373.149,33	2.256,59	487,24	0,00%	-	-	-
HBSA3	383.097,00	54.483,62	26.350,01	-0,03%	50.810,18	212,46	81.720,82
HGTX3	454.461,00	94.821,77	2.169,71	0,00%	191.763,97	624,16	172.792,37
HSM11	8.182.584,60	306.150,77	133.731,38	0,14%	102.428,84	396,87	137.163,82
HYPE3	6.980.880,00	396.876,77	135.008,88	0,14%	652.308,45	2.431,65	798.003,30
IFCM3	4.600.000,00	1.249.885,24	312.487,48	0,33%	-	-	-
IGTA3	153.660,00	22.279,75	2.688,31	0,00%	17.630,84	65,08	21.086,40
IRBR3	339.300,00	14.799,37	346,10	0,00%	6.147,21	24,18	8.535,64
ISPU21	9.550.773,00	659.860,93	332.312,11	-0,35%	860.099,63	85.956,96	1.306.809,16
ITSA4	4.777.640,00	474.494,22	424.437,99	0,45%	1.294.477,35	4.467,96	1.328.461,13
ITUB4	47.255.210,55	5.103.356,19	4.346.093,77	4,62%	14.391.273,17	49.004,01	14.328.137,53
JBSS3	15.419.924,00	2.402.673,68	1.176.612,55	-1,25%	1.230.710,59	4.999,62	1.845.250,76
JHSF3	97.418,00	8.138,95	2.875,59	0,00%	12.510,03	45,90	14.749,74
JRDM11	839.183,10	30.999,84	2.164,16	0,00%	4.671,57	18,26	6.390,14
KLBN11	935.976,00	67.239,97	21.803,99	-0,02%	98.770,82	406,86	153.154,70
LAME3	15.079,95	3.646,43	1.764,86	0,00%	3.746,80	13,05	3.925,83
LAME4	7.072.626,00	1.647.446,60	916.414,13	0,97%	1.468.933,91	5.205,40	1.599.819,46
LCAM3	1.878.124,13	161.623,88	108.493,55	0,12%	325.330,42	1.170,10	366.498,83
LREN3	14.548.341,60	1.560.038,71	503.061,03	0,54%	2.720.575,63	9.726,65	3.023.332,77
LVI11	4.132.751,50	277.077,13	118.952,09	0,13%	67.045,36	259,30	89.395,71
LWSA3	7.252.595,00	1.625.673,79	549.824,05	0,58%	609.478,69	2.281,93	753.204,93
MALL11	7.603.909,60	275.329,54	59.660,74	-0,06%	201.903,83	797,75	283.222,43
MATD3	855.063,00	73.373,11	24.743,03	-0,03%	-	-	-
MAXR11	1.465.883,50	2.701.823,52	1.018.508,42	1,08%	177.212,13	736,17	280.500,48
MDNE3	236.176,00	56.155,04	15.895,78	0,02%	28.200,59	103,88	33.563,12
MGLU3	20.104.320,83	3.886.405,26	2.548.647,44	2,71%	2.842.288,39	10.367,26	3.306.650,77
MOV13	10.092.310,00	1.478.386,89	1.207.077,70	1,28%	2.957.108,74	10.115,91	2.974.659,35
MRFG3	271.078,00	42.104,96	26.798,59	-0,03%	8.536,72	33,81	12.047,15
MRVE3	936.735,36	66.721,93	16.384,44	0,02%	19.433,12	74,99	25.776,18
MULT3	9.735.978,33	1.128.559,95	130.987,01	0,14%	1.556.623,13	5.631,43	1.777.190,32
NEWU11	428.169,06	24.781,50	3.549,61	0,00%	27.994,48	-	41.206,44



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.716.976.851,04	VAR / PL:	2,529%
VAR:	94.003.470,63	ETL / PL:	3,1715%
ETL:	117.884.185,03	VAR / CDI:	15672,24%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	255.430.530,38	BAIXA 1:	268.433.316,24	Cenário 1:	324.702.385,21
				Cenário 2:	- 69.637.604,42
				Cenário 3:	- 497.007.510,32

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
NTCO3	24.052.083,09	3.220.457,36	2.319.382,08	2,47%	6.840.360,68	23.481,34	6.934.558,17
OIBR3	1.450.713,84	140.045,45	18.617,05	0,02%	- 109.050,21	441,91	162.530,73
OMGE3	1.953.197,07	170.412,53	102.277,54	0,11%	186.679,44	695,21	227.853,01
PACUCAR_CBD ON ED	147.098,00	43.318,12	23.326,32	0,02%	23.394,72	84,67	26.732,34
PARD3	773.846,85	94.102,04	71.035,42	0,08%	194.078,54	675,43	202.910,23
PATC11	8.422.047,75	907.430,77	551.306,40	0,59%	- 203.477,16	802,99	284.602,94
PETR3	32.398.688,00	4.638.768,07	4.046.835,11	4,30%	13.466.523,87	43.934,18	12.196.728,04
PETR4	61.096.617,12	6.538.869,74	5.663.274,34	6,02%	19.313.746,57	65.463,92	19.032.913,78
PETZ3	3.811.400,00	520.680,16	60.936,62	0,06%	285.848,98	1.074,77	356.746,70
PNVL3	1.854.594,00	182.992,71	143.425,32	0,15%	395.448,89	1.398,05	428.394,66
POWE3	134.850,00	2.583,52	1.000,73	0,00%	-	-	-
PRI03	10.090.318,42	826.148,35	278.887,23	0,30%	1.183.977,52	4.365,53	1.412.172,93
PVBI11	7.122.868,74	211.836,70	38.147,56	0,04%	- 4.980,73	-	6.773,90
QAGR11	8.607.860,53	372.369,87	105.926,78	0,11%	- 63.118,57	-	86.519,70
QUAL3	522.540,00	74.823,71	52.850,04	0,06%	90.933,66	326,94	102.359,03
RADL3	10.606.944,00	1.276.700,32	54.638,14	-0,06%	434.852,84	1.661,64	563.603,16
RAIL3	10.986.858,40	823.735,53	210.503,54	-0,22%	- 31.069,70	121,30	42.361,85
RAPT4	5.969.768,00	735.160,70	22.946,00	-0,02%	179.742,81	690,45	235.861,56
RBGS11	617.487,00	33.185,25	18.843,12	-0,02%	- 59.738,45	244,90	91.562,75
RBRL11	2.006.292,62	91.364,51	27.460,09	-0,03%	-	-	-
RCRB11	1.633.651,80	180.400,50	41.992,03	0,04%	27.604,89	106,73	36.778,53
RDOR3	4.312.845,00	457.925,75	148.978,72	-0,16%	- 355.200,40	-	-
RECV3	683.472,00	121.413,74	36.901,18	0,04%	-	-	-
RENT3	5.347.407,51	387.179,99	208.565,38	0,22%	502.503,46	1.872,76	614.390,07
RNGO11	190.899,80	7.022,14	3.779,56	0,00%	3.234,74	12,51	4.309,47
SANB11	679.780,00	81.652,01	69.141,02	0,07%	196.547,40	673,41	198.403,88
SBSP3	2.644.188,00	329.241,29	176.780,74	-0,19%	- 299.979,60	1.241,05	470.090,59
SDIL11	381.689,10	10.810,81	3.283,52	0,00%	- 7.059,66	27,78	9.807,07
SEER3	585.756,00	145.208,75	109.916,26	0,12%	410.814,20	1.214,83	301.247,73
SOMA3	81.600,00	22.912,38	16.217,70	0,02%	49.988,01	152,16	38.973,17
SPY	1.487.273,53	103.173,44	48.172,76	-0,05%	- 88.444,51	13.195,47	129.217,08
STBP3	9.445.050,00	933.449,41	542.672,44	0,58%	3.752.260,87	12.326,15	3.450.151,75
SULA11	3.045.862,05	315.442,08	63.762,89	0,07%	295.928,04	1.101,26	360.586,76
SUZB3	19.370.757,78	1.657.791,20	1.309.977,91	-1,39%	- 4.246.116,28	18.677,58	7.742.141,14
TAEE11	376.932,00	49.453,77	19.413,77	-0,02%	23.155,23	87,62	29.332,75
TCSA3	195.220,00	27.204,28	14.234,69	0,02%	37.235,64	132,91	41.227,94



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.716.976.851,04	VAR / PL:	2,529%
VAR:	94.003.470,63	ETL / PL:	3,1715%
ETL:	117.884.185,03	VAR / CDI:	15672,24%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	255.430.530,38	BAIXA 1:	268.433.316,24	Cenário 1:	324.702.385,21
				Cenário 2:	- 69.637.604,42
				Cenário 3:	- 497.007.510,32

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
TEND3	1.394.666,00	126.703,08	22.703,63	0,02%	50.134,13	192,04	65.350,64
TEPP11	4.371.600,94	151.819,84	23.698,26	-0,03%	293.113,02	1.182,70	432.360,72
TIMS3	597.870,00	47.441,55	32.578,27	0,03%	38.279,76	144,67	48.353,30
TOTS3	12.770.230,00	1.806.424,18	1.077.635,17	1,15%	3.191.067,00	11.109,77	3.339.117,70
TRXF11	13.627.858,30	363.217,91	109.365,99	-0,12%	443.913,10	1.759,37	627.285,16
UGPA1	0,04	0,54	0,01	0,00%	-	-	-
UGPA3	6.134.393,56	471.014,18	40.950,17	0,04%	33.106,12	128,72	44.703,23
USIM5	455.770,00	124.906,63	88.112,38	-0,09%	108.313,95	481,90	203.231,40
VALE3	103.094.263,12	9.618.532,49	4.889.911,85	-5,20%	384.099,90	1.494,70	519.668,85
VIVT3	873.852,00	53.909,33	35.793,64	0,04%	79.850,98	297,95	97.902,69
VTV_US	2.649.557,70	132.887,85	66.382,10	-0,07%	238.607,24	23.846,02	362.532,57
VVAR3	1.179.072,00	311.151,72	203.083,91	0,22%	600.024,98	1.892,54	504.916,00
VVPR11	94.348,90	20.150,69	12.099,33	0,01%	-	-	-
WEGE3	10.021.360,00	1.576.677,74	846.062,85	0,90%	886.581,33	3.312,59	1.090.418,08
WEST3	45.500,00	-	-	0,00%	-	-	-
WSPU21	1.432.615,95	91.239,30	42.684,34	-0,05%	129.014,94	12.893,54	196.021,37
XPIN11	2.168.858,23	58.909,24	4.778,96	0,01%	93.666,77	-	134.096,09
XPIN12	2.369,28	5.632,74	47,53	0,00%	1.019,34	-	2.719,32
XPPR11	3.424.190,80	345.290,63	153.561,42	0,16%	179.292,62	-	229.428,56
YDUQ3	6.078.482,55	891.022,47	713.267,39	0,76%	1.938.357,82	6.562,87	1.905.519,21
INDQ21	-	460.552,47	401.943,96	0,43%	-	-	-
WINQ21	-	10.349,49	9.032,45	-0,01%	-	-	-
DI1N21	-	7.234,25	485,59	0,00%	14.470,86	7.555,08	22.483,29
DI1Q21	-	7.197,20	5.346,06	0,01%	39.700,50	20.716,58	61.629,38
DI1V21	-	115.435,00	72.645,97	-0,08%	522.688,97	272.291,31	809.113,82
DI1F22	-	383.483,45	97.387,09	0,10%	1.081.439,31	561.764,46	1.666.081,65
DI1N22	-	54.785,38	15.660,05	0,02%	163.587,02	84.532,60	249.825,89
DAPQ22	-	38.063,83	14.018,97	0,01%	12.346,18	4.515,71	27.435,17
DI1F23	-	2.120.579,25	1.344.605,79	1,43%	6.727.355,09	3.458.414,64	10.185.656,54
DAPK23	-	138.711,59	54.221,32	0,06%	81.316,44	29.620,74	178.964,59
DI1F24	-	95.104,62	80.188,55	-0,09%	230.501,51	117.266,55	342.978,50
DI1N24	-	20.683,83	17.952,41	0,02%	46.345,39	23.454,60	68.361,18
DAPQ24	-	117.069,89	41.098,52	0,04%	114.595,61	41.467,59	248.312,47
DI1F25	-	1.784.548,95	1.534.360,21	1,63%	3.869.965,48	1.947.844,37	5.656.740,61
DAPK25	-	22.675,45	5.884,17	0,01%	-	-	-
DI1F26	-	23.930,88	20.607,36	-0,02%	48.682,98	24.243,18	69.911,98



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.716.976.851,04	VAR / PL:	2,529%
VAR:	94.003.470,63	ETL / PL:	3,1715%
ETL:	117.884.185,03	VAR / CDI:	15672,24%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	255.430.530,38	BAIXA 1:	268.433.316,24	Cenário 1:	324.702.385,21
				Cenário 2:	- 69.637.604,42
				Cenário 3:	- 497.007.510,32

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
DAPQ26	-	26.768,43	10.772,31	0,01%	-	-	-
DI1F27	-	2.175.426,02	1.798.705,34	-1,91%	- 4.408.454,26	2.171.265,99	6.216.508,76
DAPQ28	-	14.140,97	9.544,40	0,01%	-	-	-
DI1F29	-	2.699.068,48	2.144.894,45	2,28%	5.724.772,87	- 2.757.976,10	- 7.784.137,83
DOLN21	-	310.048,69	154.883,99	0,16%	556.882,07	55.556,06	846.171,37
WDON21	-	310.048,69	154.883,99	-0,16%	- 556.882,07	- 55.556,06	- 846.171,37
COMPROMISSADA	430.514.256,87	5.598,40	375,78	0,00%	11.198,63	5.846,69	17.399,25
EMP AÇÃO PROVISÃO	- 45.729,59	5,06	3,78	0,00%	- 29,73	15,51	46,14
DE252 AEGEA SA CDI -	1.326.394,92	74,78	59,07	0,00%	147,03	- 75,87	- 224,02
DE252 ALUPAR CDI -	6.351.039,38	2.123,42	1.789,84	0,00%	5.157,72	- 2.625,30	- 7.681,46
DE252 AMPL CDI -	4.239.697,73	2.772,76	2.279,98	0,00%	- 7.441,61	3.811,59	11.198,92
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.724.403,93	224,17	180,68	0,00%	- 566,83	- 290,91	- 855,86
DE252 BCBF CDI - BCBF14	273.171,22	116,01	96,14	0,00%	301,35	- 153,69	- 450,30
DE252 BCBF CDI - BCBF15	3.734.484,58	1.716,15	1.428,69	0,00%	4.442,63	- 2.264,15	- 6.630,32
DE252 BRKA CDI - BRKP18	2.707.198,88	2.024,27	1.691,18	0,00%	5.225,45	- 2.661,27	- 7.789,64
DE252 CBD CDI - CBRDB6	3.503.712,05	988,69	409,16	0,00%	- 3.062,48	1.585,77	4.693,06
DE252 CELPA CDI -	2.568.195,00	149,32	117,00	0,00%	311,93	- 161,13	- 476,05
DE252 COPEL GT CDI -	436.165,51	381,60	271,50	0,00%	- 1.181,44	609,26	1.798,21
DE252 COPEL GT CDI -	292.108,41	262,11	223,11	0,00%	- 656,94	335,47	983,67
DE252 CORSAN CDI -	1.653.834,56	15.239,67	13.245,45	0,01%	30.391,03	- 15.314,09	- 44.487,17
DE252 COSAN LO CDI -	2.641.296,47	1.035,73	855,17	0,00%	2.674,93	- 1.364,46	- 3.998,01
DE252 DASA CDI - DASAA2	2.664.340,91	433,55	355,19	0,00%	1.077,33	- 551,54	- 1.619,92
DE252 ECORODOV CDI -	1.874.288,03	22.619,12	18.026,49	0,02%	46.815,71	- 22.745,41	- 64.549,43
DE252 ECORODOV CDI -	2.190.584,65	338,38	221,19	0,00%	1.028,04	- 530,16	- 1.564,68
DE252 ENERSUL CDI -	975.684,97	297,84	127,82	0,00%	- 923,03	480,83	1.428,81
DE252 GETI CDI - TIET19	2.417.117,30	17.561,13	13.937,01	0,01%	40.868,64	- 19.456,27	- 54.505,04
DE252 GETI CDI - TIET27	4.081.846,06	186,03	143,53	0,00%	236,33	- 122,29	- 361,71
DE252 GUAR CDI - GUAR24	3.607.529,69	2.033,65	1.685,31	0,00%	5.352,11	- 2.728,33	- 7.990,91
DE252 LAME CDI -	365.974,99	46,41	24,49	0,00%	137,65	- 71,47	- 211,90
DE252 LOCALIZA CDI -	1.136.198,29	240,37	21,32	0,00%	- 619,35	322,51	958,07
DE252 MOV_PART CDI -	1.410.414,15	60,71	39,23	0,00%	- 0,01	-	0,01
DE252 NATURA CDI -	5.716.459,49	246,06	159,00	0,00%	- 0,03	0,00	0,04
DE252 OMEGA GE CDI -	2.212.520,57	2.725,32	2.310,47	0,00%	6.096,67	- 3.042,35	- 8.787,74
DE252 OURO VER CDI -	2.186.272,42	1.676,86	1.429,83	0,00%	4.079,63	- 2.067,27	- 6.030,95
DE252 SABEREDU CDI -	932.970,36	40,16	25,95	0,00%	- 0,00	0,00	0,01
DE252 SANEAMEN CDI -	2.637.192,88	1.017,25	842,86	0,00%	2.647,32	- 1.350,14	- 3.955,63



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.716.976.851,04	VAR / PL:	2,529%
VAR:	94.003.470,63	ETL / PL:	3,1715%
ETL:	117.884.185,03	VAR / CDI:	15672,24%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	255.430.530,38	BAIXA 1:	268.433.316,24	Cenário 1:	324.702.385,21
				Cenário 2:	- 69.637.604,42
				Cenário 3:	- 497.007.510,32

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
SBFC11	4.184.767,49	31.623,87	27.375,14	0,03%	66.654,59	33.962,78	99.358,33
DE252 SUL AME CDI -	1.310.755,85	246,64	109,85	0,00%	828,19	428,94	1.269,65
DE252 TELEF BR CDI -	5.091.086,98	16.738,51	11.145,78	0,01%	38.679,59	20.425,02	61.152,59
DE252 TENDA CDI - TEND14	194.527,42	11,91	9,49	0,00%	23,95	12,36	36,47
DE252 USIMINAS CDI -	3.419.405,84	6.785,73	5.218,36	0,01%	17.961,66	9.263,52	27.332,80
DE252 USIMINAS CDI -	5.462.530,53	2.526,26	2.120,71	0,00%	6.330,36	3.223,09	9.432,36
DE252 VAMOS CDI -	1.652.335,36	932,77	792,99	0,00%	2.262,82	1.147,65	3.350,09
LF selic	11.584.782,83	14.584,24	12.595,55	-0,01%	33.338,11	17.413,00	51.835,69
LF252 B.ALFA CDI -	991.477,65	42,68	27,58	0,00%	0,00	0,00	0,01
LFSN B VOTORA CDI -	2.265.607,74	190,54	40,34	0,00%	815,83	425,73	1.266,54
LFT	169.641.725,56	409.849,82	304.468,87	0,32%	0,84	-	1,14
CMTR33	5.133.824,75	36.505,17	17.970,07	0,02%	2.139,89	784,25	4.777,75
CRI RB CAPIT IPCA M D -	8.723.957,47	104.904,42	51.945,67	0,06%	133.133,58	48.473,93	266.264,98
DE252 AEGEA SA IPCA -	13.500.451,13	172.535,36	65.705,49	0,07%	195.623,49	71.524,43	402.258,54
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.965.218,04	64.989,80	25.052,78	0,03%	60.948,58	22.196,30	126.838,36
DE252 CEMIG - IPCA	2.504.363,24	28.152,43	12.164,55	0,01%	21.845,21	7.913,53	47.458,42
DE252 COMGAS IGPM-100 -	39.376.831,68	937.294,48	252.860,46	0,27%	1.390.123,64	49.088,65	38.395.289,99
DE252 CSMG IPCA -	13.683.818,81	163.508,73	66.245,60	0,07%	155.155,17	56.746,39	321.026,15
DE252 DUKE GEP - IPCA	21.335.360,30	148.651,44	54.038,47	0,06%	65.353,40	23.808,11	143.864,23
DE252 ECORODOV IPCA -	10.314.516,80	145.879,01	55.924,90	0,06%	164.638,96	60.389,53	338.384,33
DE252 ECORODOV IPCA -	3.310.145,36	43.326,53	16.701,85	0,02%	40.632,38	14.797,54	84.558,91
DE252 ECPT - IPCA	2.927.461,39	23.029,84	12.166,40	0,01%	5.191,58	1.894,79	11.478,25
DE252 ECPT - IPCA	440.510,84	3.019,56	1.430,60	0,00%	398,10	145,85	888,11
DE252 ECPT - IPCA	1.783.340,12	7.890,99	2.770,38	0,00%	915,69	334,88	2.034,24
DE252 ECPT - IPCA	2.995.931,88	22.838,60	11.748,21	0,01%	2.145,67	781,07	4.714,33
DE252 IMED - IPCA	1.080.487,05	7.116,90	3.332,50	0,00%	1.214,80	454,78	2.622,24
DE252 IRB IPCA - IRBR12	6.139.859,85	93.615,49	48.079,55	0,05%	145.807,73	53.073,76	290.013,79
DE252 LAME - IPCA	8.135.435,79	36.118,25	11.974,08	0,01%	966,83	355,90	2.181,23
DE252 LIGHT IPCA -	4.593.069,28	38.838,57	17.440,40	0,02%	17.567,26	6.445,09	37.555,40
DE252 LOCALIZA IPCA -	20.888.967,15	359.882,18	281.816,45	0,30%	884.481,13	308.465,22	1.654.342,47
DE252 PETR IPCA - PETR45	15.734.121,28	189.055,28	70.051,45	0,07%	156.187,70	56.724,59	329.450,73
DE252 RD COLIN - IPCA	8.167.019,67	53.167,02	23.723,57	0,03%	44.323,55	19.578,85	81.832,83
DE252 SABESP - IPCA	9.880.743,87	81.977,80	43.632,22	0,05%	25.196,07	9.194,61	55.688,52
DE252 SABESP IPCA -	13.895.416,56	187.856,87	72.729,33	0,08%	187.372,49	68.062,07	390.895,55
DE252 TRANS AL - IPCA	15.293.289,28	155.433,26	69.772,87	0,07%	104.307,39	37.817,21	227.044,06
DEBI ANET IPCA - ANET11	3.033.064,77	43.208,34	23.538,92	0,03%	65.085,61	23.271,23	129.697,75



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.716.976.851,04	VAR / PL:	2,529%
VAR:	94.003.470,63	ETL / PL:	3,1715%
ETL:	117.884.185,03	VAR / CDI:	15672,24%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	255.430.530,38	BAIXA 1:	268.433.316,24	Cenário 1:	324.702.385,21
				Cenário 2:	- 69.637.604,42
				Cenário 3:	- 497.007.510,32

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 B2W IPCA - BTOW15	3.451.030,06	59.930,63	49.022,60	0,05%	152.075,94 -	54.945,63 -	278.129,60
DEBI BRISANET IPCA -	3.425.321,40	52.317,39	27.873,84	0,03%	83.475,44 -	29.942,58 -	166.306,86
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	7.609.967,92	131.917,92	90.777,61	0,10%	341.417,02 -	113.805,71 -	642.764,02
DEBI CAGECE IPCA -	3.255.273,49	59.842,68	11.410,12	0,01%	66.391,83 -	17.260,54 -	157.138,59
DEBI CORSAN IPCA -	1.662.492,24	26.127,97	16.585,06	0,02%	49.837,58 -	17.356,02 -	97.584,21
DEBI ELETROB IPCA -	11.983.908,16	197.728,27	133.630,02	0,14%	384.481,19 -	135.184,72 -	751.310,01
DEBI ENERGMIR IPCA -	1.009.024,05	14.160,58	6.741,14	0,01%	19.162,99 -	6.970,57 -	38.501,90
DEBI ENTREVIA IPCA -	27.019.641,83	424.740,69	326.402,06	0,35%	930.623,55 -	341.630,41 -	1.746.148,28
DEBI IGUA SAN IPCA -	11.586.824,87	181.694,73	131.106,02	0,14%	436.135,81 -	154.331,73 -	806.277,70
DEBI JAGUARA IPCA -	1.668.939,53	22.842,49	10.816,67	0,01%	29.980,98 -	10.909,17 -	60.344,33
DEBI LAME IPCA -	7.405.563,21	125.978,60	103.966,67	0,11%	316.702,97 -	115.526,11 -	577.356,06
DEBI METRORIO IPCA -	6.733.370,36	113.295,76	79.496,63	0,08%	239.307,77 -	86.807,82 -	453.918,15
DEBI MG050 IPCA -	564.548,65	8.677,11	5.812,06	0,01%	17.106,01 -	6.099,14 -	32.875,65
DEBI NEOENERG IPCA -	5.924.182,45	102.786,96	66.572,25	0,07%	195.882,18 -	67.154,58 -	390.020,93
DEBI NORTE EN IPCA -	2.038.205,11	31.148,99	21.116,94	0,02%	61.515,05 -	22.498,18 -	117.513,43
DEBI PAMPASUL IPCA -	1.405.481,14	18.324,74	10.284,77	0,01%	26.929,41 -	9.734,49 -	53.381,66
DEBI PAMPASUL IPCA -	1.144.463,10	19.375,46	15.557,53	0,02%	55.104,02 -	19.987,44 -	95.828,61
DEBI PAMPASUL IPCA -	5.698.150,95	94.194,82	73.765,90	0,08%	235.827,06 -	82.628,31 -	435.821,90
DEBI QUATA IPCA -	4.445.561,23	64.777,62	29.097,57	0,03%	91.485,40 -	33.590,73 -	183.362,65
DEBI RIO PR IPCA - RPR22	535.008,49	9.425,95	7.106,60	0,01%	21.865,30 -	7.467,64 -	41.782,15
DEBI TAUBATE IPCA -	9.518.215,89	159.369,21	105.637,85	0,11%	386.352,05 -	131.633,99 -	710.478,38
DEBI VIARONDO IPCA -	8.956.810,17	152.305,39	109.403,00	0,12%	373.563,58 -	130.112,12 -	692.886,86
ECCR32	6.831.570,32	51.699,63	26.966,47	0,03%	8.883,98 -	3.240,73 -	19.617,09
LFS ITAU IPCA -	4.967.787,71	37.314,46	14.143,40	0,02%	12.367,10 -	4.522,97 -	27.476,00
LFS ITAU IPCA M D -	785.537,14	6.976,91	3.480,84	0,00%	3.027,57 -	1.105,83 -	6.705,84
LFS ITAU IPCA M D -	3.927.685,69	34.884,55	17.404,19	0,02%	15.137,86 -	5.529,14 -	33.529,20
LFS ITAU IPCA M D -	9.426.445,66	83.722,91	41.770,06	0,04%	36.330,87 -	13.269,94 -	80.470,09
LFS ITAU IPCA M D -	7.069.834,25	62.792,18	31.327,55	0,03%	27.248,15 -	9.952,46 -	60.352,57
LFS ITAU IPCA M D -	5.498.759,97	48.838,36	24.365,87	0,03%	21.193,01 -	7.740,80 -	46.940,89
LFS ITAU IPCA M D -	7.869.520,67	70.931,74	35.922,88	0,04%	31.362,73 -	11.454,04 -	69.447,80
LFSN BRADESCO IPCA -	11.887.053,46	199.569,26	68.036,52	0,07%	224.100,54 -	80.905,12 -	482.960,37
LFSN BRADESCO IPCA M D	3.855.124,10	67.107,86	24.377,79	0,03%	86.704,28 -	31.221,07 -	185.726,31
NTNB	1.881.272.855,89	59.652.792,06	57.740.679,50	61,42%	185.490.038,51 -	60.640.776,11 -	320.030.936,55
DOLNPF3	- 930,28	16.306,23 -	8.145,73	-0,01%	- 13.847.645,51 -	14.457,09	930,28
DOLNPH5	211,75	3.620,18	1.808,45	0,00%	6.346.654,35	3.191,84 -	211,75
DOLNPH6	1.120,37	19.969,46	9.975,69	0,01%	7.500.589,33	17.286,75 -	1.120,37



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.716.976.851,04	VAR / PL:	2,529%
VAR:	94.003.470,63	ETL / PL:	3,1715%
ETL:	117.884.185,03	VAR / CDI:	15672,24%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	255.430.530,38	BAIXA 1:	268.433.316,24	Cenário 1:	324.702.385,21
				Cenário 2:	- 69.637.604,42
				Cenário 3:	- 497.007.510,32

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
DOLUP8V	- 77.704,96	121.885,15	61.007,22	0,06%	75.813,13	18.204,35	- 1.354.460,43
DOLUP8Z	24.158,30	44.525,92	22.287,14	-0,02%	23.826,74	6.491,49	796.279,36
DOLUPDB	618.604,59	948.510,17	474.919,55	0,51%	4.512.090,92	173.654,60	- 616.409,78
IBOV5120	- 53.043,26	87.271,95	77.452,17	0,08%	53.021,72	1.354,22	- 1.933.256,56
IBOV5126	216.091,79	302.546,19	268.503,63	-0,29%	216.021,90	4.713,08	2.694.527,09
IDIFQHK	-	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00
IDIFQHL	-	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00
IDIFQHM	- 0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,01
IDIFQHN	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,06
IDIFQHP	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,02
IDIVPDX	1,02	6,56	2,19	0,00%	0,70	0,70	- 7.461.833,22
IDIVPDY	- 20,10	120,05	40,02	0,00%	14,17	14,16	3.985.804,09
IDIVPDZ	75,65	420,67	140,23	0,00%	54,60	54,59	4.391.341,90
AB AMERICAN GROWTH	6.656.345,92	381.843,69	80.652,77	-0,09%	599.440,55	59.907,11	4.702.479,10
FIDC CELG DIST SN B	6.380.341,46	111.631,59	56.308,03	-0,06%	464.485,09	1.879,89	- 10.009.510,93
FIDC CREDZ MZ4	12.972,86	11,06	0,32	0,00%	87,98	-	5.324.753,48
FIDC VERDECARD SN4	9.000.000,00	14.522,79	728,03	0,00%	1.011,73	-	9.797.379,66
FII VIA PQ SHOPPING	1.855.630,93	-	-	0,00%	-	-	- 24.150.725,57
FUNDSMITH EQ FUND	9.143.333,29	1.614.466,95	293.713,08	-0,31%	823.407,44	82.290,00	14.364.206,52
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.198.636,06	580.153,73	185.786,06	-0,20%	-	-	910.771,71
JANUS H GL FICFIA IE	4.355.410,60	542.742,56	145.282,82	-0,15%	-	-	690.181,65
LOOMIS US GROWTH	6.490.963,98	323.094,36	155.631,47	-0,17%	584.547,00	58.418,68	120,51
MFS MERIDIAN EUROPEA	5.264.433,97	221.092,94	114.162,34	-0,12%	474.091,23	47.379,91	1.375,02
PICTET GL FIC FIM IE	3.542.910,49	398.876,20	97.868,98	-0,10%	-	-	-
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	4.375.416,66	46.385,19	11.949,09	-0,01%	-	-	1.251.060,17
Total	4.009.624.506,26	186.688.341,99	94.003.470,63	100,00%	324.702.385,21	- 69.637.604,42	-497.007.510,32



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2021

EMBRAERPREV RENDA FIXA CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	1.973.516.911,38	VAR / PL:	2,853%
VAR:	56.311.208,55	ETL / PL:	3,5782%
ETL:	70.616.551,53	VAR / CDI:	17681,98%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 216.803.786,81	BAIXA 1:	234.924.613,11	Cenário 1:	183.132.482,00
				Cenário 2:	- 59.630.560,95
				Cenário 3:	- 317.516.128,53

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
FI RF EMB II	2.090.470.633,44	55.536.904,64	55.515.598,69	98,59%	181.012.178,45	- 58.929.047,19	- 313.216.467,56
FI RF EMB V CP	170.810.026,71	1.731.783,50	795.609,86	1,41%	2.120.303,55	- 701.513,76	- 4.299.660,97
Total	2.261.280.660,14	57.268.688,15	56.311.208,55	100,00%	183.132.482,00	- 59.630.560,95	- 317.516.128,53



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	837.649.809,51	VAR / PL:	3,810%
VAR:	31.916.159,85	ETL / PL:	4,7782%
ETL:	40.024.165,79	VAR / CDI:	23611,58%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 524,74	BAIXA 1:	525,73	Cenário 1:	118.252.003,83
				Cenário 2:	398.054,81
				Cenário 3:	- 113.598.508,64

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
FIA RVA EMB II	603.794.900,47	23.562.046,42	23.506.870,91	73,65%	87.414.436,46	294.428,73	- 83.951.924,28
FIA RVA EMB III	62.954.397,49	2.189.302,54	2.068.141,98	6,48%	7.366.248,26	24.634,19	- 6.985.942,62
FIA RVA EMB IV	63.086.272,71	2.144.728,94	1.999.941,89	6,27%	7.183.875,96	24.751,85	- 7.372.722,27
FIA RVA EMB V	105.881.668,57	4.386.313,44	4.341.205,08	13,60%	16.287.443,15	54.240,04	- 15.287.919,47
Total	835.717.239,24	32.282.391,33	31.916.159,85	100,00%	118.252.003,83	398.054,81	- 113.598.508,64



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 30/06/2021

FI RF EMB II CNPJ - 11005764000196

Dados Gerais

PL:	1.778.651.162,09	VAR / PL:	3,340%
VAR:	59.412.175,25	ETL / PL:	4,1889%
ETL:	74.505.290,22	VAR / CDI:	20699,58%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(211.458.029,18)	BAIXA 1:	232.316.165,87	Cenário 1:	226.253.979,94
				Cenário 2:	(58.884.532,73)
				Cenário 3:	(373.339.479,97)

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	25,82	11,03	0,00%	107,03	0,41	(141,86)
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(60.215,97)	310,97	(132,81)	0,00%	(1.289,01)	(4,97)	1.708,44
COMPROMISSADA	140.460.495,82	725.636,58	309.520,88	0,52%	3.010.410,91	9.692,85	(3.990.811,83)
DE252 COM GAS IGPM-100 - GASP17	32.682.873,09	820.461,29	394.575,26	0,66%	1.798.188,74	(37.828,61)	(3.119.874,94)
DE252 CSM G IPCA - CSMGC3	13.661.780,28	218.206,72	98.374,30	0,17%	451.125,74	(56.809,83)	(715.999,47)
DE252 LAME - IPCA LAME38	2.105.883,27	17.227,44	8.193,27	0,01%	44.745,97	296,73	(58.994,67)
DE252 PETR IPCA - PETR45	15.710.879,14	253.362,89	107.666,80	0,18%	496.086,53	(56.649,80)	(782.709,04)
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	9.653.635,26	122.119,81	67.066,99	0,11%	232.702,07	(8.710,24)	(331.479,53)
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	7.850.872,12	137.084,39	60.000,05	0,10%	276.747,66	(38.769,20)	(449.517,44)
DEBI ELETROB IPCA - ELET42	11.951.432,55	234.551,53	159.959,16	0,27%	644.450,43	(135.497,32)	(1.098.531,38)
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	11.640.810,37	214.940,60	163.730,40	0,28%	654.918,09	(147.869,78)	(1.091.542,86)
DEBI IGUA SAN IPCA - IGSN15	2.425.943,15	44.570,27	32.108,17	0,05%	143.909,02	(32.407,61)	(238.812,83)
DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16	5.907.490,93	121.276,08	79.715,78	0,13%	324.441,32	(67.316,26)	(561.784,70)
LFS ITAU IPCA - LFS0120016V	4.964.328,74	59.010,62	26.779,82	0,05%	119.248,81	(4.336,59)	(169.676,57)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GU	785.057,23	10.304,24	5.335,43	0,01%	19.922,31	(1.073,53)	(29.175,53)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GZ	3.925.286,17	51.521,19	26.677,14	0,04%	99.611,57	(5.367,65)	(145.877,66)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H2	9.420.686,80	123.650,87	64.025,14	0,11%	239.067,77	(12.882,36)	(350.106,40)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H4	7.065.515,10	92.738,15	48.018,86	0,08%	179.300,83	(9.661,77)	(262.579,80)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H6	5.495.400,63	72.129,67	37.348,00	0,06%	139.456,20	(7.514,71)	(204.228,73)
NTNB	1.809.375.616,34	57.768.154,85	57.723.201,60	97,16%	217.380.827,94	(58.271.822,49)	(359.739.343,18)
Total	2.095.028.771,01	61.087.283,99	59.412.175,25	100,00%	226.253.979,94	(58.884.532,73)	(373.339.479,97)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 30/06/2021

FI RF EMB V CREDITO PRIVADO CNPJ - 20726178000121

Dados Gerais

PL:	194.865.749,29	VAR / PL:	0,889%
VAR:	1.731.783,50	ETL / PL:	1,1145%
ETL:	2.171.727,12	VAR / CDI:	5507,25%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(5.805.825,20)	BAIXA 1:	3.113.895,69	Cenário 1:	2.120.303,55
				Cenário 2:	(701.513,75)
				Cenário 3:	(4.299.660,97)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	998,08	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(41.162,10)	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	1.101.290,79	14,16	5,01	0,00%	28,63	(14,95)	(44,48)
CMTR33	5.133.824,75	36.079,67	28.831,99	1,66%	3.027,01	(1.109,35)	(6.758,11)
CRF RB CAPIT IPCA M D - 17H0164854	8.707.594,40	104.216,34	103.533,36	5,98%	135.589,53	(49.288,51)	(271.314,99)
DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23	13.471.973,81	172.441,84	167.422,72	9,67%	200.046,29	(72.994,29)	(411.350,40)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.955.579,01	64.962,06	63.485,41	3,67%	62.423,87	(22.698,09)	(129.949,39)
DE252 CEMIG - IPCA CMDT33	2.501.242,09	28.058,90	27.734,30	1,60%	22.511,52	(8.152,38)	(48.870,76)
DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17	6.761.973,74	159.478,36	63.709,98	3,68%	227.289,24	(8.385,01)	(453.640,95)
DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24	21.331.983,24	147.674,05	138.514,76	8,00%	66.934,15	(24.379,66)	(147.282,41)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	10.288.521,33	145.800,13	141.494,31	8,17%	168.457,14	(61.668,19)	(346.259,53)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36	3.303.719,34	43.308,04	42.323,60	2,44%	41.615,91	(15.132,06)	(86.632,93)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	2.926.994,02	22.707,12	20.129,55	1,16%	5.657,99	(2.065,39)	(12.514,84)
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	440.510,84	2.994,92	2.469,15	0,14%	465,73	(170,60)	(1.038,64)
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	1.783.999,04	7.735,02	5.736,77	0,33%	943,28	(344,78)	(2.092,78)
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	2.992.805,09	22.399,03	17.079,50	0,99%	2.778,68	(1.013,59)	(6.135,34)
DE252 IMED - IPCA SULM23	1.079.925,37	7.061,83	5.863,16	0,34%	1.374,12	(513,73)	(2.978,73)
DE252 LAME - IPCA LAME38	6.036.497,86	26.038,13	10.802,31	0,62%	(955,98)	352,09	2.159,48
DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34	8.163.944,65	52.643,45	50.988,12	2,94%	45.360,50	(20.002,19)	(83.903,13)
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	224.503,15	1.835,83	1.680,39	0,10%	605,86	(221,10)	(1.339,23)
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	6.016.598,98	81.476,20	79.608,32	4,60%	83.294,51	(30.208,03)	(173.789,77)
DE252 TRANS AL - IPCA TAE33	15.270.745,62	154.691,36	152.254,03	8,79%	108.254,09	(39.241,37)	(235.541,99)
DEBI ENERGMIR IPCA - ENMI21	1.006.591,56	14.080,20	13.869,58	0,80%	19.507,22	(7.084,30)	(39.205,21)
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	15.302.815,30	234.355,29	208.895,76	12,06%	533.365,55	(195.650,84)	(1.000.753,24)
DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21	1.665.068,68	22.720,33	22.423,95	1,29%	30.534,71	(11.092,75)	(61.479,10)
ECR32	6.824.840,72	50.773,99	42.311,54	2,44%	10.190,75	(3.720,16)	(22.542,38)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001IP	7.865.169,70	69.788,84	66.636,29	3,85%	32.251,77	(11.777,24)	(71.395,17)
LFSN BRADESCO IPCA - LFSN16000GM	11.850.043,24	199.836,20	190.690,04	11,01%	229.996,77	(82.994,10)	(495.113,95)
LFSN BRADESCO IPCA M D - LFSN1800DC5	3.841.434,34	66.931,81	63.289,62	3,65%	88.754,73	(31.943,16)	(189.893,00)
Total	170.810.026,65	1.940.103,09	1.731.783,50	100,00%	2.120.303,55	(701.513,75)	(4.299.660,97)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 30/06/2021

FIM EMB I A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	149.074.389,52	VAR / PL:	0,069%
VAR:	103.227,54	ETL / PL:	0,0868%
ETL:	129.451,54	VAR / CDI:	429,11%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(332.932,08)	BAIXA 1:	339.823,46	Cenário 1:	187.661,48
				Cenário 2:	(83.282,12)
				Cenário 3:	(337.183,45)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(17.822,50)	-	-	0,00%	-	-	-
DI1F24	-	34.310,38	16.737,01	16,21%	89.281,05	(45.401,99)	(132.753,51)
COMPROMISSADA	130.075.700,18	1.672,35	685,11	0,66%	3.381,23	(1.765,31)	(5.253,42)
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.724.352,11	212,61	110,06	0,11%	573,85	(294,42)	(866,00)
DE252 BCBF CDI - BCBF14	273.143,00	109,60	56,66	0,05%	304,87	(155,43)	(455,26)
DE252 LAME CDI - LAMEA1	365.965,63	44,49	37,80	0,04%	139,56	(72,45)	(214,78)
DE252 LOCALIZA CDI - LORTA1	603.316,59	127,07	(114,47)	-0,11%	(333,28)	173,53	515,45
DE252 MOV_PART CDI - MOVI33	1.410.414,15	60,10	(13,99)	-0,01%	(0,01)	-	0,01
DE252 NATURA CDI - NATU27	630.641,44	26,87	(6,25)	-0,01%	(0,00)	-	0,00
DE252 SABEREDU CDI - SSED11	679.445,80	28,95	(6,74)	-0,01%	(0,00)	-	0,00
DE252 SUL AME CDI - SULM15	1.310.827,48	238,12	(210,81)	-0,20%	(839,18)	434,55	1.286,10
DE252 TELEF BR CDI - VIVT15	2.163.169,15	6.727,50	3.829,61	3,71%	16.768,08	(8.848,63)	(26.481,25)
LF selic	3.998.553,46	2.430,98	(1.026,13)	-0,99%	(6.045,21)	3.156,81	9.395,93
LF252 BALFA CDI - LF0021006S0	991.477,65	42,25	(9,83)	-0,01%	(0,00)	(0,00)	0,01
LFT	435.771,52	17,60	(9,41)	-0,01%	(0,00)	-	0,00
NTNB	6.475.379,77	89.286,15	83.168,90	80,57%	84.430,54	(30.508,77)	(182.356,73)
Total	151.129.335,44	135.335,04	103.227,54	100,00%	187.661,48	(83.282,12)	(337.183,45)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 30/06/2021

FIM EMB II A CNPJ - 20725957000102

Dados Gerais

PL:	142.616.652,20	VAR / PL:	0,226%
VAR:	321.623,72	ETL / PL:	0,2828%
ETL:	403.329,25	VAR / CDI:	1397,51%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	858.045,76	BAIXA 1:	131.961,85	Cenário 1:	106.022,27
				Cenário 2:	236.748,71
				Cenário 3:	244.791,30

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	7,35	5,98	0,00%	50,15	0,19	(67,70)
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(38.690,27)	31,59	(25,71)	-0,01%	(215,57)	(0,84)	291,02
WSPU21	1.450.960,02	89.366,84	68.427,64	21,28%	(124.651,69)	(13.027,21)	191.136,54
WINQ21	(254.508,00)	10.354,06	4.389,11	1,36%	(1.418,04)	(5,51)	1.914,38
DI1V21	(98.780,84)	80,43	(40,45)	-0,01%	(746,40)	99,97	1.046,43
DI1F22	(97.213,93)	196,07	(52,66)	-0,02%	(983,42)	227,35	1.411,68
DI1N22	187.587,35	675,50	10,37	0,00%	2.973,08	(991,95)	(4.354,19)
DI1F24	(10.887.049,67)	119.997,26	106.356,91	33,07%	(385.542,96)	164.976,98	564.966,62
DI1N24	1.274.819,69	18.852,73	(17.644,18)	-5,49%	53.933,70	(23.661,22)	(78.611,15)
DI1F25	(8.685.664,91)	160.470,90	151.601,81	47,14%	(431.379,04)	192.464,29	624.600,70
DI1F29	1.065.349,81	49.403,84	(47.740,92)	-14,84%	117.632,10	(53.743,70)	(159.685,89)
COMPROMISSADA	96.285.801,46	79.385,49	64.468,23	20,04%	538.976,58	779,01	(728.141,24)
DE252 AEGEA SA CDI - AEGP13	1.326.382,05	1.031,85	815,49	0,25%	7.539,13	(48,11)	(10.203,77)
DE252 COPEL GT CDI - CPGT14	436.276,85	576,17	550,06	0,17%	1.233,84	626,56	(1.460,54)
DE252 COPEL GT CDI - CPGT16	292.166,51	432,67	420,47	0,13%	963,18	345,63	(1.202,98)
DE252 ECOMODOV CDI - ERDV18	1.871.439,89	20.363,42	(19.689,38)	-6,12%	57.457,04	(22.791,96)	(78.842,50)
DE252 ENERSUL CDI - ESUL18	975.771,49	821,04	756,91	0,24%	4.500,23	508,92	(5.890,31)
DE252 LOCALIZA CDI - LORTA1	532.929,66	386,76	342,19	0,11%	2.674,92	164,83	(3.553,33)
DE252 NATURA CDI - NATU27	1.118.879,97	868,31	703,74	0,22%	6.234,04	24,24	(8.416,10)
DE252 SABEREDU CDI - SSED11	253.524,55	196,75	159,46	0,05%	1.412,56	5,49	(1.906,99)
DE252 TELEF BR CDI - VIVT15	2.923.201,56	8.860,29	(3.633,56)	-1,13%	38.946,72	(11.894,29)	(57.773,51)
DE252 TENDA CDI - TEND14	194.525,26	150,72	118,72	0,04%	1.108,09	(8,30)	(1.500,12)
DE252 USIMINAS CDI - USIM27	47.645,76	31,37	12,56	0,00%	321,32	(27,39)	(441,55)
LF selic	3.652.535,54	4.163,81	3.932,67	1,22%	16.192,32	2.251,00	(21.008,93)
LFSN B VOTORA CDI - LFSN14000H2	2.265.644,59	1.792,80	1.515,85	0,47%	11.800,22	478,64	(15.764,04)
LFT	33.686.739,97	17.292,67	4.762,84	1,48%	187.691,58	729,72	(253.388,19)
IDIFQG0	(43,50)	71,75	(19,27)	-0,01%	23,51	36,16	(21,30)
IDIFQG1	43,50	72,77	19,55	0,01%	(23,72)	(36,30)	21,67
IDIFQG7	60,00	109,82	29,50	0,01%	(34,50)	(51,18)	33,35
IDIFQG8	(120,00)	223,16	(59,94)	-0,02%	69,64	102,72	(68,01)
IDIFQG9	60,00	113,40	30,46	0,01%	(35,14)	(51,53)	34,68
IDIFQHM	(630,00)	3.376,96	(907,07)	-0,28%	511,38	542,08	(1.523,01)
IDIFQHN	1.470,00	7.439,53	1.998,29	0,62%	(1.192,55)	(1.275,19)	3.220,08
IDINPDG	(29,00)	102,11	(82,92)	-0,03%	28,84	4,07	(3.393.199,16)
IDINPDH	29,00	112,04	90,99	0,03%	(28,84)	(4,43)	3.683.138,65
Total	129.790.114,15	597.412,23	321.623,72	100,00%	106.022,27	236.748,71	244.791,30



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 30/06/2021

FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A CNPJ - 34081188000161

Dados Gerais

PL:	219.358.462,50	VAR / PL:	2,932%
VAR:	6.432.259,50	ETL / PL:	3,6772%
ETL:	8.066.315,68	VAR / CDI:	18171,31%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(29.682.764,79)	BAIXA 1:	35.181.705,75	Cenário 1:	23.381.402,63
				Cenário 2:	(8.710.413,29)
				Cenário 3:	(28.949.394,99)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	500,00	-	-	0,00%	0,41	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(307.661,06)	-	-	0,00%	251,17	-	-
ANIM3	764.935,90	64.031,98	2.634,68	0,04%	64.032,18	550,55	(169.666,49)
Banco BTG Pactual SA UNT	14.769,26	1.589,37	330,99	0,01%	1.591,99	7,68	(2.447,24)
CEAB3	14.762,08	1.380,80	663,68	0,01%	1.378,54	15,31	(4.477,19)
COGN3	669.786,05	103.107,40	64.168,55	1,00%	102.710,69	802,08	(228.450,91)
GNDI3	2.470.443,84	180.114,99	94.361,53	1,47%	179.250,44	711,60	(235.956,42)
GUAR3	8.373,66	808,72	297,88	0,00%	810,69	10,85	(3.041,11)
ISPU21	9.673.066,78	640.119,68	(360.515,24)	-5,60%	646.189,89	(87.057,60)	1.347.003,49
LAME3	14.565,30	3.465,91	1.833,05	0,03%	3.456,66	13,61	(4.047,16)
LREN3	24.238,04	2.724,95	(42,49)	0,00%	2.731,26	15,49	(4.839,63)
MGLU3	1.441.351,35	273.415,19	192.926,74	3,00%	272.379,52	777,72	(247.053,96)
OIBR3	1.441.169,67	138.045,65	28.173,68	0,44%	137.458,19	(390,57)	142.793,34
SUZB3	1.815.412,93	153.305,97	(85.891,03)	-1,34%	153.908,65	(1.745,22)	723.037,66
VALE3	4.066.354,50	371.615,01	(137.559,73)	-2,14%	373.828,61	(22,92)	7.995,81
YDUQ3	694.401,80	98.263,22	60.946,38	0,95%	97.957,83	752,82	(218.420,44)
INDQ21	-	462.866,14	279.714,94	4,35%	462.866,14	-	-
DI1Q21	-	7.518,90	5.180,90	0,08%	7.518,90	(20.747,41)	(61.720,74)
DI1V21	-	110.855,70	(78.805,07)	-1,23%	110.855,70	274.572,97	815.858,47
DI1F22	-	376.867,98	112.544,29	1,75%	376.867,98	(566.977,47)	(1.681.390,39)
DI1N22	-	52.542,49	22.038,28	0,34%	52.542,49	(84.661,31)	(250.169,64)
DI1F23	-	2.005.520,18	1.661.349,17	25,83%	2.005.520,18	(3.478.939,70)	(10.244.090,65)
DI1F25	-	1.852.053,58	1.800.222,78	27,99%	1.852.053,58	(2.159.735,29)	(6.269.688,31)
DI1F27	-	2.084.560,78	(1.945.580,33)	-30,25%	2.084.560,78	2.195.735,04	6.284.109,86
DI1F29	-	2.515.854,67	2.275.162,61	35,37%	2.515.854,67	(2.699.092,30)	(7.613.956,21)
COMPROMISSADA	13.015.565,04	167,34	(14,77)	0,00%	10.731,04	(176,64)	(525,67)
LFT	134.739.158,26	370.632,19	210.606,09	3,27%	284.869,09	-	0,87
NTNB	58.933.287,87	2.060.821,57	1.880.396,19	29,23%	2.024.867,21	(2.223.934,21)	(11.580.336,05)
DOLUP8V	(144.100,20)	181.993,51	115.430,82	1,79%	182.083,90	29.134,62	(1.655.945,23)
DOLUP8Z	68.520,30	93.766,48	(59.472,79)	-0,92%	93.809,45	(14.842,18)	1.102.963,76
DOLUPDB	450.487,95	691.861,12	438.933,21	6,82%	691.578,63	134.124,11	(448.943,08)
IBOV5120	(61.166,72)	98.907,86	62.394,82	0,97%	98.921,27	1.530,33	(1.992.608,97)
IBOV5126	237.398,55	331.582,58	(209.174,37)	-3,25%	331.634,63	(5.149,65)	2.741.664,92
IDIFQFP	70,30	112,74	(3,60)	0,00%	112,78	(57,98)	33,83
IDIFQFZ	(70,30)	114,31	3,65	0,00%	114,35	58,21	(34,38)
IDIFQGO	(70,30)	115,91	3,71	0,00%	115,95	58,44	(34,96)
IDIFQG1	70,30	117,57	(3,76)	0,00%	117,61	(58,66)	35,55
IDIFQHK	468,64	2.909,23	(93,67)	0,00%	2.909,49	(393,94)	1.475,96
IDIFQHL	(1.405,92)	8.163,55	262,79	0,00%	8.164,34	1.194,98	(3.920,66)
IDIFQHM	(4.271,85)	22.895,79	736,87	0,01%	22.898,20	3.675,76	(10.359,25)
IDIFQHN	8.548,68	43.259,23	(1.391,99)	-0,02%	43.264,05	(7.415,98)	18.790,45
IDIFQHP	3.151,82	14.996,87	(482,47)	-0,01%	14.998,65	(2.756,56)	6.253,95
IDINPDG	(32,61)	114,79	74,45	0,00%	114,82	4,57	(3.815.594,20)
IDINPDH	1,40	5,41	(3,51)	0,00%	5,41	(0,21)	177.806,70
IDINPDJ	31,12	133,32	(86,47)	0,00%	133,35	(5,23)	4.263.526,23
IDINPDK	31,12	149,88	(97,21)	0,00%	149,91	(5,82)	4.574.663,46
IDINPDL	(62,13)	342,38	222,07	0,00%	342,44	13,11	(9.754.331,54)
IDINPDM	31,12	200,98	(130,35)	0,00%	201,00	(7,56)	5.196.937,94
IDIVPDX	232,63	861,02	(250,47)	0,00%	861,18	(167,86)	8.163.314,72
IDIVPDY	(465,26)	1.900,60	552,89	0,01%	1.900,93	325,20	(20.500.616,87)
IDIVPDZ	232,63	1.061,69	(308,86)	0,00%	1.061,86	(156,06)	12.485.005,36
Total	230.052.112,54	15.427.817,20	6.432.259,50	100,00%	23.381.402,63	(8.710.413,29)	(28.949.394,99)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 30/06/2021

FIM EMB III A IMOBILIÁRIO CNPJ - 32711990000162

Dados Gerais

PL:	89.148.779,33	VAR / PL:	3,730%
VAR:	3.325.551,17	ETL / PL:	4,6780%
ETL:	4.170.376,76	VAR / CDI:	23116,67%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(16,53)	BAIXA 1:	16,59	Cenário 1:	(2.481.175,55)
				Cenário 2:	(10.211,28)
				Cenário 3:	3.592.620,50

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	18,32	7,73	0,00%	(13,34)	(0,05)	18,42
CONTAS A PAGAR / RECEBER	42.233,42	773,74	326,37	0,01%	(563,39)	(2,21)	777,82
BLCP11	1.526.877,30	28.019,08	11.981,42	0,36%	(20.368,36)	(79,94)	28.120,63
BMLC11	1.710.474,80	31.336,98	13.218,00	0,40%	(22.817,53)	(89,55)	31.501,96
BPML11	1.368.771,00	77.290,04	(23.797,63)	-0,72%	(118.661,77)	(478,14)	174.503,06
BTLG11	239.690,36	6.684,29	(2.438,70)	-0,07%	(5.777,85)	(22,66)	7.965,98
BTLG13	33.915,26	621,35	262,09	0,01%	(452,43)	(1,78)	624,62
BTLG14	924.604,10	16.939,33	7.145,04	0,21%	(12.334,11)	(48,41)	17.028,51
CBOP11	36.904,92	2.285,31	1.962,35	0,06%	2.039,63	7,62	(2.502,45)
CEOC11	564.908,19	17.485,54	5.818,11	0,17%	(26.674,02)	(105,48)	37.490,97
CJCT11	2.114.662,60	105.153,00	(75.591,78)	-2,27%	(162.359,92)	(650,98)	235.923,52
CNES11	638.187,00	44.218,45	28.485,28	0,86%	(12.931,34)	(50,70)	17.806,56
FIGS11	450.118,00	44.922,57	37.543,07	1,13%	49.926,80	182,02	(57.940,62)
HBRH11	1.373.149,33	25.380,85	11.226,30	0,34%	(18.317,65)	(71,89)	25.289,41
HSML11	8.288.274,00	279.290,73	86.383,33	2,60%	(16.957,39)	(71,04)	27.116,39
JRDM11	845.460,00	27.062,73	(16.846,49)	-0,51%	(17.819,57)	(69,87)	24.541,61
LVB11	4.148.812,43	276.532,66	186.309,65	5,60%	39.439,67	148,17	(49.009,23)
MALL11	7.619.884,20	218.140,18	(113.025,66)	-3,40%	(294.336,61)	(1.159,80)	410.216,90
MAXR11	1.474.416,00	2.683.740,60	2.131.995,80	64,11%	(195.438,33)	(806,69)	304.742,16
NEWU11	600.237,00	10.996,72	4.638,44	0,14%	(8.007,09)	(31,43)	11.054,62
PATC11	8.403.121,80	939.096,97	595.248,44	17,90%	(313.837,83)	(1.236,03)	436.883,89
PVB11	7.199.179,74	213.682,37	130.180,19	3,91%	(92.315,97)	(376,92)	127.535,58
QAGR11	8.601.212,25	180.708,21	(11.890,18)	-0,36%	(163.278,04)	(450,33)	224.810,53
RBGS11	641.316,78	33.998,96	(20.387,04)	-0,61%	(72.159,49)	(294,67)	109.611,96
RBRL11	2.018.200,00	74.594,54	(65.562,47)	-1,97%	(26.922,55)	(105,67)	37.169,36
RCRB11	1.625.466,00	167.071,58	93.307,48	2,81%	22.041,89	83,12	(27.652,04)
RNGO11	191.271,08	6.930,01	2.413,25	0,07%	502,72	1,80	(550,98)
SDIL11	385.678,15	7.370,41	3.349,53	0,10%	(11.083,70)	(43,53)	15.322,43
TEPP11	4.443.006,40	166.394,10	41.151,71	1,24%	(348.414,96)	(1.398,10)	507.271,63
TRXF11	13.696.672,50	390.257,84	(59.822,75)	-1,80%	(634.221,27)	(2.506,94)	890.576,82
VVPR11	1.086.602,50	19.907,24	8.396,91	0,25%	(14.495,15)	(56,89)	20.012,05
XPIN11	2.191.520,87	32.209,95	(2.525,60)	-0,08%	(117.826,87)	(114,74)	166.761,10
XPIN12	95.580,11	1.751,09	738,61	0,02%	(1.275,03)	(5,00)	1.760,31
XPPR11	3.479.394,00	347.969,36	298.530,89	8,98%	163.561,69	(182,17)	(202.234,20)
COMPROMISSADA	620.911,61	11.372,03	4.793,55	0,14%	(8.266,75)	(40,94)	11.410,30
FII VIA PQ SHOPPING	1.556.213,34	28.510,81	12.025,92	0,36%	(20.759,70)	(81,48)	28.660,91
Total	90.237.927,03	6.518.717,97	3.325.551,17	100,00%	(2.481.175,55)	(10.211,28)	3.592.620,50



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 30/06/2021

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	605.353.378,45	VAR / PL:	0,870%
VAR:	5.267.867,05	ETL / PL:	1,0913%
ETL:	6.606.120,07	VAR / CDI:	5392,66%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(409,00)	BAIXA 1:	410,41	Cenário 1:	181.741.747,72
				Cenário 2:	608.501,92
				Cenário 3:	(172.499.061,72)

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	419,27	178,36	0,00%	1.562,24	5,20	(1.466,51)
CONTAS A PAGAR / RECEBER	1.244.870,09	52.194,26	22.203,02	0,42%	194.478,70	647,54	(182.561,47)
ABEV3	21.506.578,35	2.357.523,42	395.483,63	7,51%	10.124.760,98	34.130,88	(9.829.732,54)
ASAI3	7.511.672,00	926.210,13	744.508,01	14,13%	1.173.504,15	3.907,31	(1.101.594,35)
B3SA3	24.211.195,78	1.554.343,39	322.655,43	6,12%	2.522.832,54	7.551,50	(1.727.504,76)
Banco BTG Pactual SA UNT	18.711.798,00	1.915.134,24	1.501.784,13	28,51%	5.591.693,09	19.461,11	(5.844.612,13)
BBAS3	11.627.847,00	1.193.034,84	(171.722,76)	-3,26%	5.509.016,86	18.556,91	(5.339.412,58)
BBDC4	33.927.346,43	2.528.035,16	7.250,11	0,14%	14.015.507,51	47.902,71	(14.036.027,18)
BID11	6.791.067,00	1.408.375,10	310.556,78	5,90%	1.010.189,01	3.333,92	(926.354,62)
BPAN4	2.858.328,00	591.003,11	257.562,08	4,89%	2.101.639,39	6.581,98	(1.741.070,06)
BRAP4	3.634.737,00	519.906,98	205.961,09	3,91%	400.163,94	1.221,48	(292.121,20)
CCRO3	5.301.990,00	507.586,27	284.450,23	5,40%	1.398.662,27	4.870,32	(1.464.868,35)
CESP6	6.107.094,00	395.135,82	121.192,09	2,30%	556.667,78	1.574,84	(310.876,98)
CIEL3	3.893.344,00	682.762,23	131.412,44	2,49%	1.514.331,52	5.202,36	(1.534.476,55)
COGN3	2.369.376,00	303.689,13	(217.571,38)	-4,13%	1.221.500,70	4.069,85	(1.155.619,17)
CPFE3	5.777.577,00	319.349,13	5.101,36	0,10%	1.369.284,68	4.755,26	(1.426.071,87)
CSED3	5.759.124,00	641.785,44	(204.225,79)	-3,88%	899.713,93	2.995,70	(844.581,40)
CSNA3	11.960.881,00	3.238.969,56	1.756.547,22	33,34%	25.397,61	(1.579,81)	1.300.196,52
ELET6	8.593.422,00	676.187,92	235.993,14	4,48%	4.168.478,05	14.000,68	(4.014.189,82)
GND3	7.771.095,00	414.252,63	63.396,55	1,20%	1.809.842,77	6.280,69	(1.881.869,90)
GOLL4	3.850.392,00	613.878,93	376.662,88	7,15%	947.776,46	3.295,69	(989.856,27)
HAPV3	17.792.386,00	1.033.549,84	28.766,88	0,55%	4.347.455,24	15.114,00	(4.538.325,37)
HYPE3	3.991.626,00	197.498,49	60.391,88	1,15%	991.174,57	3.447,44	(1.035.717,41)
IFCM3	3.200.000,00	134.167,93	57.073,97	1,08%	499.917,10	1.664,53	(469.283,26)
ITUB4	39.793.042,60	3.018.832,97	(1.601.050,69)	-30,39%	18.614.568,71	62.797,74	(18.102.628,28)
JBSS3	13.383.090,00	2.180.042,68	556.765,74	10,57%	963.617,15	2.371,72	(263.025,69)
LAME4	6.169.722,00	1.318.923,81	(996.738,44)	-18,92%	2.356.422,66	8.106,60	(2.395.486,63)
LEN3	12.057.098,00	1.141.125,16	286.741,89	5,44%	4.031.025,28	13.978,80	(4.175.635,36)
LWSA3	6.562.050,00	1.365.910,42	(615.117,43)	-11,68%	1.677.986,03	5.840,19	(1.755.832,19)
MGLU3	15.570.630,00	2.729.318,14	(1.646.821,35)	-31,26%	4.743.092,57	16.500,90	(4.952.323,26)
MOVI3	10.087.187,00	1.216.108,42	(696.553,27)	-13,22%	4.607.225,28	15.585,77	(4.508.213,41)
MULT3	8.744.350,00	969.784,23	188.855,89	3,59%	2.715.155,31	9.441,17	(2.831.349,71)
NTCO3	13.294.182,00	1.499.300,62	(919.231,55)	-17,45%	5.978.578,42	20.259,85	(5.872.764,69)
PETR3	25.207.338,00	2.836.828,83	(1.367.433,55)	-25,96%	14.520.255,68	47.583,00	(13.248.698,28)
PETR4	47.331.062,37	3.712.554,49	(932.056,03)	-17,69%	22.391.687,91	75.438,80	(21.710.821,99)
PETZ3	3.799.600,00	541.539,32	(44.584,76)	-0,85%	911.123,14	3.165,55	(949.827,54)
PNVL3	1.841.679,00	129.361,46	(91.282,32)	-1,73%	691.233,70	2.381,01	(704.765,72)
PRIO3	6.644.141,00	419.277,70	(55.037,19)	-1,04%	1.799.014,01	6.265,70	(1.884.756,87)
RADL3	9.454.046,00	1.220.311,50	758.334,20	14,40%	1.802.344,82	6.165,01	(1.811.340,91)
RAIL3	4.984.745,00	418.755,46	229.868,20	4,36%	743.763,11	2.456,06	(683.095,18)
RAPT4	5.965.372,00	732.023,14	435.451,37	8,27%	1.078.578,83	3.667,81	(1.068.479,38)
RDOR3	4.286.763,00	527.735,21	442.588,49	8,40%	309.475,61	2.229,83	(628.658,16)
SBSPP3	2.194.800,00	302.691,48	160.629,22	3,05%	99.633,63	136,76	57.982,96
STBP3	9.413.775,00	767.787,08	127.360,94	2,42%	5.093.706,69	16.854,32	(4.746.413,51)
SUZB3	12.607.948,00	1.504.591,32	628.570,35	11,93%	(786.750,68)	(5.562,28)	3.172.490,38
TOTS3	12.428.265,00	1.536.112,12	(580.060,96)	-11,01%	5.059.085,91	17.314,08	(5.081.846,49)
UGPA1	11.733,28	150.445,47	42.658,86	0,81%	1.833,02	6,10	(1.720,70)
UGPA3	4.373.142,00	325.379,90	(61.401,04)	-1,17%	747.689,36	2.524,39	(727.473,73)
VALE3	81.584.733,75	9.126.456,36	5.415.244,07	102,80%	12.627.648,75	41.977,76	(11.804.061,59)
WEGE3	7.411.800,00	986.310,01	1.867.153,26	-14,52%	6.496,54	6.496,54	(1.952.522,97)
YDUQ3	4.827.480,00	536.171,92	(202.414,40)	-3,84%	2.300.831,70	7.744,66	(2.226.413,34)
COMPROMISSADA	15.361.378,61	644.024,21	274.007,61	5,20%	2.400.216,77	7.781,98	(2.253.382,24)
Total	603.794.900,26	64.062.696,66	5.267.867,05	100,00%	181.741.747,72	608.501,92	(172.499.061,72)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 30/06/2021

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	62.960.632,20	VAR / PL:	1,255%
VAR:	789.849,47	ETL / PL:	1,5732%
ETL:	990.503,45	VAR / CDI:	7774,14%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(77,52)	BAIXA 1:	77,79	Cenário 1:	17.201.241,97
				Cenário 2:	57.380,88
				Cenário 3:	(16.218.269,17)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	41,93	28,13	0,00%	156,22	0,52	(146,65)
CONTAS A PAGAR / RECEBER	246.470,35	10.333,88	6.934,15	0,88%	38.504,61	128,21	(36.145,13)
ALSO3	1.193.544,00	96.379,36	(21.642,27)	-2,74%	499.400,02	1.704,84	(498.780,41)
ASAI3	967.257,58	119.265,56	27.903,69	3,53%	151.108,94	503,13	(141.849,31)
B3SA3	1.756.008,00	112.734,60	70.363,42	8,91%	182.977,91	547,70	(125.293,78)
BBAS3	1.024.947,00	105.161,13	(65.546,38)	-8,30%	485.597,23	1.635,72	(470.647,31)
BBRK3	31.204,00	14.234,12	4.649,17	0,59%	4.885,89	16,27	(4.591,14)
BBSE3	323.400,00	26.464,14	(3.126,98)	-0,40%	97.057,70	337,77	(101.425,18)
BKBR3	226.480,00	24.545,36	5.640,96	0,71%	89.300,43	306,45	(90.260,90)
BMGB4	183.540,00	17.466,07	(1.988,30)	-0,25%	60.659,22	210,46	(62.912,11)
BRAP4	1.887.982,00	270.053,93	106.411,73	13,47%	207.856,12	634,47	(151.735,76)
BRDT3	2.942.937,40	196.514,04	(30.163,02)	-3,82%	1.211.430,96	4.141,81	(1.214.100,16)
BRML3	2.044.396,38	248.952,49	(38.579,51)	-4,88%	655.867,90	2.278,22	(682.161,74)
BTOW3	1.027.030,00	281.899,28	14.253,26	1,80%	411.311,84	1.409,65	(414.499,66)
CESP6	2.070.810,00	133.983,72	104.155,15	13,19%	188.756,42	534,00	(105.413,01)
CPFE3	2.381.535,00	131.636,69	(15.661,32)	-1,98%	564.423,35	1.960,13	(587.831,21)
CRFB3	1.377.600,00	135.501,52	38.913,26	4,93%	395.643,53	1.377,77	(414.195,25)
CYRE COM - CPP ON	233.240,00	18.316,42	2.649,64	0,34%	47.918,29	165,02	(48.947,49)
ELET6	1.237.522,00	97.376,51	(44.117,21)	-5,59%	600.294,42	2.016,21	(578.075,67)
ENGI11	1.020.726,40	48.575,32	(11.600,46)	-1,47%	323.298,46	1.123,50	(336.623,98)
EQTL3	3.023.120,00	318.667,30	112.190,81	14,20%	597.152,30	2.049,59	(605.126,22)
ESPA3	47.500,00	7.056,44	(2.646,77)	-0,34%	7.420,64	24,71	(6.965,92)
EUCATEX PN	83.160,00	22.965,09	4.434,32	0,56%	9.952,54	31,19	(7.880,15)
EV EN3	26.150,00	1.922,13	(464,86)	-0,06%	9.804,03	33,77	(9.997,77)
GMAT3	754.776,00	34.755,89	18.669,96	2,36%	142.000,52	485,05	(142.230,14)
GNDI3	458.622,00	24.447,70	(1.779,15)	-0,23%	108.810,39	370,66	(111.061,17)
HAPV3	659.548,00	38.312,78	(5.820,05)	-0,74%	161.156,32	560,26	(168.231,70)
HBSA3	392.873,00	62.676,58	16.813,25	2,13%	6.171,29	(27,50)	32.144,05
HGTX3	256.575,00	55.413,65	(8.406,91)	-1,06%	147.733,48	484,16	(134.816,03)
HYPE3	2.437.029,00	120.579,82	22.088,02	2,80%	605.147,17	2.104,78	(632.342,15)
ITSA4	2.398.365,00	161.098,89	(65.048,64)	-8,24%	1.035.719,24	3.524,81	(1.027.224,48)
ITUB4	375.480,00	28.485,17	(12.905,45)	-1,63%	175.643,73	592,55	(170.813,15)
JBSS3	334.650,00	54.512,92	20.848,45	2,64%	24.095,67	59,31	(6.577,07)
LCAM3	90.453,00	5.350,79	138,51	0,02%	30.372,63	105,31	(31.447,20)
LREN3	667.873,00	63.209,79	(9.943,52)	-1,26%	223.288,63	774,32	(231.298,95)
MDNE3	234.088,00	56.057,44	12.757,98	1,62%	67.614,76	235,44	(70.772,83)
MULT3	210.560,00	23.351,97	(2.207,29)	-0,28%	65.379,71	227,34	(68.177,62)
NTCO3	3.290.920,00	371.145,69	3.204,20	0,41%	1.479.972,46	5.015,24	(1.453.778,71)
OMGE3	1.060.200,00	65.807,61	11.350,81	1,44%	269.955,30	939,49	(282.431,71)
PARD3	766.185,00	67.425,15	(14.860,28)	-1,88%	310.358,57	1.062,62	(312.062,53)
PETR3	2.798.796,00	314.975,95	(94.789,28)	-12,00%	1.612.198,54	5.283,19	(1.471.016,25)
POWE3	134.850,00	5.724,87	3.519,86	0,45%	21.066,82	70,14	(19.775,89)
PRI03	765.957,00	48.335,62	3.941,38	0,50%	207.395,87	722,33	(217.280,57)
QUAL3	323.792,00	38.906,78	(11.079,61)	-1,40%	103.927,61	361,00	(108.089,40)
RAIL3	2.024.806,10	170.098,69	38.640,20	4,89%	302.116,98	997,65	(277.473,63)
RECV3	687.300,00	127.143,86	32.486,14	4,11%	107.372,82	357,51	(100.793,25)
RENT3	3.549.888,00	201.894,68	55.343,25	7,01%	916.288,52	3.189,66	(959.116,20)
SEER3	595.932,00	130.470,53	(15.895,27)	-2,01%	522.968,59	1.573,13	(398.435,70)
SOMA3	81.294,00	19.780,88	(3.317,72)	-0,42%	62.491,57	193,85	(50.744,87)
SULA11	2.541.131,14	247.337,95	115.009,15	14,56%	639.410,65	2.224,69	(668.608,60)
SUZB3	2.805.089,00	334.750,16	195.437,92	24,74%	(175.040,83)	(1.237,53)	705.833,96
TCSA3	191.134,00	25.280,64	1.874,14	0,24%	70.466,28	243,09	(72.069,64)
TEND3	1.385.265,00	128.221,58	71.551,79	9,06%	279.238,29	960,13	(284.179,51)
TIMS3	157.961,00	9.658,14	207,20	0,03%	35.268,82	122,14	(36.499,31)
VALE3	2.208.375,00	247.039,33	65.841,23	8,34%	341.811,30	1.136,27	(319.518,04)
WEST3	45.500,00	1.907,70	1.280,09	0,16%	7.108,20	23,67	(6.672,62)
COMPROMISSADA	2.911.570,14	122.067,28	81.908,51	10,37%	454.933,09	1.474,98	(427.102,32)
Total	62.954.397,49	5.846.273,49	789.849,47	100,00%	17.201.241,97	57.380,88	(16.218.269,17)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 30/06/2021

FIA RVA EMB IV CNPJ - 38452613000132

Dados Gerais

PL:	63.408.321,97	VAR / PL:	3,382%
VAR:	2.144.728,94	ETL / PL:	4,2417%
ETL:	2.689.577,53	VAR / CDI:	20960,57%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(56,86)	BAIXA 1:	57,06	Cenário 1:	7.183.875,96
				Cenário 2:	24.751,85
				Cenário 3:	(7.372.722,27)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	762.078,08	-	-	0,00%	-	-	-
B3SA3	2.402.518,34	128.233,46	20.637,46	0,96%	(124.986,27)	(500,36)	180.908,51
Banco BTG Pactual SA UNT	2.568.996,82	276.457,60	106.841,92	4,98%	366.360,50	1.335,57	(425.677,69)
BIDI11	2.235.995,76	420.358,03	(100.022,77)	-4,66%	(16.706,18)	(65,38)	22.903,76
BIDI12	4.173,49	-	-	0,00%	-	-	-
BRML3	2.182.107,72	295.256,98	132.968,76	6,20%	359.149,62	1.296,62	(408.104,10)
CESP6	2.480.686,74	100.337,88	(7.197,46)	-0,34%	(161.425,94)	(650,67)	237.517,77
ELET3	2.491.038,51	282.281,15	172.275,91	8,03%	900.485,84	2.998,64	(853.210,53)
ELET6	698.074,91	69.552,82	40.732,82	1,90%	229.564,51	774,21	(223.713,84)
EQTL3	8.149.230,40	791.954,69	96.600,20	4,50%	336.598,95	1.286,01	(436.106,95)
ESPA3	1.183.662,00	200.875,73	109.073,30	5,09%	-	-	-
GGPS3	1.994.191,54	734.252,88	46.998,41	2,19%	-	-	-
GMAT3	3.124.875,60	180.004,54	139.126,62	6,49%	99.720,66	382,73	(130.586,00)
GNDI3	1.742.933,46	127.073,70	90.600,00	4,22%	133.630,85	502,05	(166.470,63)
HAPV3	918.081,57	74.146,78	53.530,31	2,50%	80.900,87	302,32	(99.538,58)
LCAM3	1.368.334,61	112.967,19	92.594,81	4,32%	245.697,37	881,26	(275.052,30)
MATD3	869.573,16	72.495,61	(18.283,39)	-0,85%	-	-	-
MRVE3	822.182,84	60.149,68	33.752,04	1,57%	17.262,05	66,60	(22.889,86)
MULT3	694.636,50	87.372,43	40.023,16	1,87%	107.168,43	388,66	(123.048,52)
NTCO3	5.789.238,94	754.867,27	426.835,16	19,90%	1.699.082,61	5.811,23	(1.708.424,55)
OMGE3	884.298,00	75.723,82	53.517,17	2,50%	87.017,29	323,64	(105.889,14)
PETR4	8.085.156,75	809.496,56	510.625,34	23,81%	2.561.882,44	8.680,94	(2.522.975,80)
PRI03	2.343.263,21	189.521,22	122.809,52	5,73%	268.404,14	990,91	(321.076,26)
RAIL3	2.836.498,00	229.318,83	38.718,46	1,81%	(19.901,55)	(77,86)	27.269,76
UGPA1	3.338,00	42.835,50	10.944,45	0,51%	-	-	-
UGPA3	1.244.120,28	96.209,54	30.416,41	1,42%	18.349,46	71,02	(24.508,35)
VALE3	3.070.320,75	280.589,72	(99.394,59)	-4,63%	(4.435,20)	(17,30)	6.037,27
COMPROMISSADA	2.135.666,73	27,46	4,90	0,00%	55,52	(28,98)	(86,25)
Total	63.086.272,71	6.492.361,08	2.144.728,94	100,00%	7.183.875,96	24.751,85	(7.372.722,27)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 30/06/2021

FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	105.927.476,90	VAR / PL:	4,141%
VAR:	4.386.313,44	ETL / PL:	5,1928%
ETL:	5.500.615,89	VAR / CDI:	25660,67%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	18,65	BAIXA 1:	(19,53)	Cenário 1:	16.287.443,15
				Cenário 2:	54.240,04
				Cenário 3:	(15.287.919,47)

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	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	195.924,38	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	3.431.070,00	466.037,48	337.819,40	7,70%	1.079.246,43	3.660,38	(1.065.024,71)
ASAI3	346.160,00	38.119,37	(5.066,03)	-0,12%	-	-	-
AZUL4	662.739,00	110.860,86	82.115,72	1,87%	251.105,27	830,64	(234.451,09)
B3SA3	4.758.378,00	253.976,53	28.360,35	0,65%	(247.545,21)	(991,00)	358.303,65
Banco BTG Pactual SA UNT	1.464.720,00	157.623,00	51.149,02	1,17%	208.881,36	761,48	(242.701,20)
BBAS3	1.898.883,00	255.547,75	211.722,72	4,83%	602.997,51	2.042,70	(593.478,47)
BBDC3	1.263.289,40	122.962,87	86.858,68	1,98%	266.704,06	943,73	(289.510,18)
BBDC4	5.053.114,70	501.127,55	364.710,88	8,31%	1.298.041,39	4.506,14	(1.349.471,42)
BBSE3	713.790,00	74.411,07	49.946,56	1,14%	102.709,01	374,21	(119.181,83)
BEEF3	104.007,00	10.725,10	1.241,73	0,03%	(960,23)	(3,76)	1.319,22
BIDI11	847.911,00	159.403,79	(60.410,05)	-1,38%	(6.335,14)	(24,79)	8.685,32
BRAP4	765.599,00	92.929,28	(35.566,07)	-0,81%	(35.316,90)	(140,95)	50.745,23
BRDT3	1.432.716,00	106.207,76	49.229,89	1,12%	365.938,56	1.271,12	(380.953,51)
BRF3	1.024.875,00	290.008,29	206.445,20	4,71%	726.503,87	2.143,23	(530.060,28)
BRKM5	726.510,00	132.332,00	(25.889,69)	-0,59%	161.170,13	567,72	(173.163,53)
BRML3	394.446,00	53.371,76	24.966,78	0,57%	64.921,24	234,38	(73.770,43)
BTOW3	616.218,00	175.863,83	55.777,90	1,27%	150.519,01	525,26	(158.330,80)
CCRO3	692.675,00	69.986,56	23.759,55	0,54%	74.514,79	275,97	(89.795,27)
CIEL3	187.460,00	37.480,69	24.725,75	0,56%	43.627,54	152,98	(46.392,07)
CMIG4	606.366,57	100.900,78	46.852,36	1,07%	113.793,96	406,72	(126.375,05)
COGN3	367.184,00	56.524,60	39.031,01	0,89%	131.933,90	439,71	(125.239,27)
CPFE3	234.117,00	18.880,25	14.559,87	0,33%	18.910,97	70,91	(23.453,30)
CPL6	156.552,00	15.904,11	8.954,55	0,20%	14.801,28	55,15	(18.085,78)
CRFB3	378.000,00	43.477,57	23.788,21	0,54%	49.508,02	181,42	(58.217,05)
CSAN3	1.298.632,00	155.974,41	91.295,62	2,08%	359.543,11	1.238,00	(366.994,98)
CSNA3	1.306.503,00	329.146,04	(123.567,68)	-2,82%	(201.333,03)	(852,16)	333.622,20
CVCB1	9.512,70	2.804,15	1.072,19	0,02%	(436,24)	(1,74)	626,60
CVCB3	291.060,00	29.906,68	1.178,65	0,03%	81.805,20	281,20	(83.182,88)
CYRE3	303.420,00	31.132,39	25.344,60	0,58%	40.278,68	147,48	(47.277,27)
ECOR3	94.880,00	8.394,21	5.442,97	0,12%	13.565,29	49,44	(15.755,75)
EGIE3	461.970,00	21.069,68	16.333,87	0,37%	25.652,01	97,34	(32.709,37)
ELET3	712.305,00	80.717,45	55.434,27	1,26%	257.491,23	857,45	(243.973,00)
ELET6	484.624,00	48.285,60	32.042,50	0,73%	159.370,39	537,48	(155.308,68)
ENBR3	189.176,00	11.237,90	3.935,24	0,09%	4.174,90	16,10	(5.529,16)
ENEV3	974.652,00	137.170,01	105.423,43	2,40%	219.436,03	771,89	(235.025,14)
ENG111	540.560,00	40.458,80	32.749,87	0,75%	86.765,08	313,81	(98.996,87)
EQTL3	1.153.200,00	112.069,74	2.220,27	0,05%	47.632,22	181,98	(61.713,62)
EZTC3	136.884,00	14.373,00	7.956,02	0,18%	17.042,60	62,64	(20.175,67)
FLRY3	362.880,00	20.744,21	10.678,03	0,24%	18.068,34	68,75	(23.187,37)
GGBR4	1.359.099,00	327.327,34	(105.912,80)	-2,41%	(216.893,91)	(920,92)	362.204,60
GNDI3	2.327.082,00	169.662,78	116.833,32	2,66%	178.417,57	670,31	(222.263,68)
GOAU4	442.560,00	90.100,46	(31.541,81)	-0,72%	(54.256,20)	(225,60)	86.077,93
GOLL4	187.720,96	32.199,39	13.217,47	0,30%	16.881,10	63,03	(20.729,71)
HAPV3	899.944,00	72.681,94	52.378,83	1,19%	79.302,60	296,35	(97.572,10)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 30/06/2021

FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	105.927.476,90	VAR / PL:	4,141%
VAR:	4.386.313,44	ETL / PL:	5,1928%
ETL:	5.500.615,89	VAR / CDI:	25660,67%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	18,65	BAIXA 1:	(19,53)	Cenário 1:	16.287.443,15
				Cenário 2:	54.240,04
				Cenário 3:	(15.287.919,47)

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
HGTX3	198.418,00	42.640,80	3.368,27	0,08%	83.249,55	271,20	(75.159,53)
HYPE3	651.483,00	42.282,78	27.405,32	0,62%	59.994,67	223,79	(73.501,32)
IGTA3	157.755,00	23.828,75	4.452,38	0,10%	15.970,23	59,32	(19.375,18)
IRBR3	334.660,00	14.551,13	2.291,38	0,05%	(5.573,41)	(21,91)	7.725,29
ITSA4	2.315.855,00	221.295,56	175.173,44	3,99%	638.295,45	2.198,92	(652.262,79)
ITUB4	6.538.120,00	693.324,56	562.359,10	12,82%	2.037.019,35	6.916,96	(2.015.495,87)
JBSS3	1.868.220,00	283.974,32	(35.663,04)	-0,81%	(157.344,30)	(640,70)	237.259,15
JHSF3	97.418,00	8.579,14	4.756,86	0,11%	11.854,24	43,62	(14.074,82)
KLBN11	1.122.084,00	80.095,15	(23.690,79)	-0,54%	(117.943,76)	(485,72)	182.783,52
LAME4	843.778,00	192.475,31	79.165,25	1,80%	190.448,51	669,76	(203.868,50)
LCAM3	411.150,00	33.943,79	24.684,28	0,56%	73.825,86	264,80	(82.646,27)
LREN3	1.809.007,00	203.376,93	118.467,42	2,70%	322.191,19	1.156,35	(361.205,76)
LWSA3	535.788,00	116.042,88	32.673,21	0,74%	53.303,70	198,15	(64.788,94)
MGLU3	2.609.910,00	495.083,35	212.996,18	4,86%	387.294,47	1.408,26	(447.350,06)
MRFG3	325.380,00	48.914,74	(18.159,57)	-0,41%	(8.844,19)	(34,96)	12.415,73
MRVE3	222.088,00	16.247,63	9.693,87	0,22%	4.662,83	17,99	(6.183,01)
MULT3	267.900,00	33.696,87	16.994,22	0,39%	41.331,58	149,90	(47.456,04)
NTCO3	2.201.512,00	287.058,34	155.539,34	3,55%	646.121,33	2.209,87	(649.673,85)
PACUCAR_CBD ON ED	282.218,00	75.416,33	35.247,14	0,80%	46.376,17	167,45	(52.711,35)
PETR3	5.058.430,00	684.837,57	446.090,58	10,17%	2.123.573,39	6.917,40	(1.916.830,99)
PETR4	6.203.844,00	621.137,05	417.377,40	9,52%	1.965.765,10	6.661,00	(1.935.911,54)
PRI03	730.875,00	59.112,57	37.134,14	0,85%	83.716,53	309,07	(100.145,22)
QUAL3	378.721,00	52.844,05	30.400,57	0,69%	62.392,84	225,24	(70.886,18)
RADL3	1.223.145,00	161.787,08	38.937,00	0,89%	42.098,94	161,38	(54.972,10)
RAIL3	1.074.315,00	86.853,81	16.476,35	0,38%	(7.537,65)	(29,49)	10.328,34
RENT3	1.753.600,00	121.145,20	68.199,78	1,55%	178.680,43	663,49	(216.624,11)
SANB11	664.200,00	78.877,12	61.464,09	1,40%	194.559,23	665,59	(195.728,63)
SBSP3	574.306,00	70.828,43	(13.511,39)	-0,31%	(63.649,63)	(262,95)	99.394,77
SULA11	455.618,00	45.123,39	10.920,11	0,25%	43.466,11	161,88	(53.062,89)
SUZB3	1.997.654,00	168.695,66	(126.801,93)	-2,89%	(436.737,63)	(1.920,42)	795.620,13
TAE11	372.690,00	50.667,38	1.077,86	0,02%	24.056,73	90,90	(30.369,89)
TIMS3	431.222,00	33.438,35	20.361,57	0,46%	28.914,03	109,12	(36.401,31)
TOTS3	839.595,00	113.844,15	47.489,67	1,08%	210.603,03	732,93	(220.178,13)
UGPA1	2.417,68	31.025,32	8.022,24	0,18%	-	-	-
UGPA3	921.339,00	71.248,42	24.198,09	0,55%	13.588,78	52,59	(18.149,77)
USIM5	454.580,00	120.110,96	(60.689,93)	-1,38%	(108.263,98)	(481,84)	203.301,35
VALE3	12.842.550,00	1.173.651,82	(356.882,40)	-8,14%	(18.551,57)	(72,38)	25.252,73
VIVT3	865.200,00	55.609,61	43.424,83	0,99%	80.031,92	298,47	(98.006,22)
VVAR3	1.162.144,00	298.894,97	128.714,91	2,93%	612.291,01	1.919,09	(508.269,93)
WEGE3	2.317.872,00	350.647,18	187.351,87	4,27%	221.802,29	825,97	(270.688,89)
YDUQ3	456.476,00	64.594,88	51.205,52	1,17%	146.249,09	494,88	(143.582,13)
COMPROMISSADA	489.490,54	6,29	1,31	0,00%	12,72	(6,64)	(19,77)
EMP AÇÃO PROVISÃO	(45.729,37)	5,18	(2,21)	0,00%	(29,79)	15,54	46,24
Total	105.881.668,57	12.507.933,82	4.386.313,44	100,00%	16.287.443,15	54.240,04	(15.287.919,47)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 30/06/2021

FIM EMB V A INVEST NO EXT CNPJ - 41252756000105

Dados Gerais

PL:	71.466.661,41	VAR / PL:	4,929%
VAR:	3.522.867,21	ETL / PL:	6,1817%
ETL:	4.417.819,12	VAR / CDI:	30547,08%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	6.140.467,22	BAIXA 1:	(6.553.059,48)	Cenário 1:	(4.727.842,02)
				Cenário 2:	(477.345,75)
				Cenário 3:	7.186.784,50

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	91.309,93	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	5.307.229,34	-	-	0,00%	-	-	-
EBM	1.329.699,81	61.732,14	30.051,23	0,85%	(39.340,65)	(11.628,66)	55.389,32
EWJ_US	1.472.705,71	70.282,83	60.349,05	1,71%	(134.725,30)	(13.254,35)	205.078,68
SPY	1.504.477,18	101.026,15	81.291,36	2,31%	(90.288,97)	(13.342,36)	132.002,52
VTV_US	2.680.205,77	127.909,08	109.830,42	3,12%	(245.189,20)	(24.121,85)	373.226,67
LFT	21.479,13	74,81	(38,89)	0,00%	(0,00)	0,00	0,00
AB AMERICAN GROWTH	6.733.341,47	374.418,99	254.864,53	7,23%	(615.976,08)	(60.600,07)	937.637,94
FUND SMITH EQ FUND	9.252.805,51	1.589.727,02	923.284,58	26,21%	(846.460,39)	(83.275,25)	1.288.480,85
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.198.636,06	579.771,09	436.681,19	12,40%	-	-	-
JANUS H GL FICFIA IE	4.355.410,60	544.746,37	406.691,52	11,54%	-	-	-
LOOMIS US GROWTH	6.566.046,52	310.673,02	263.703,85	7,49%	(600.671,68)	(59.094,42)	914.341,62
MFS MERIDIAN EUROPEA	5.325.328,94	211.825,78	158.254,23	4,49%	(487.169,00)	(47.927,96)	741.567,99
PICTET GL FIC FIM IE	3.542.910,49	402.160,45	301.611,45	8,56%	-	-	-
WELLINGTON EM RESEAR	9.040.584,62	374.133,65	295.255,42	8,38%	(827.046,10)	(81.365,26)	1.258.928,46
WELLINGTON GLO QUAL	9.192.839,88	328.731,48	201.037,27	5,71%	(840.974,64)	(82.735,56)	1.280.130,46
Total	70.615.010,97	5.077.212,86	3.522.867,21	100,00%	(4.727.842,02)	(477.345,75)	7.186.784,50



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

30/06/2021

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	998.321,76	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/21	LAME	4.379.887,38	brAAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/11/22	ITAU	7.343.322,97	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	3.340.415,81	brAAA	A2.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	1.114.344,88	brAAA	A2.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/22	SUL AME	1.482.602,56	-	-	A+(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	1.393.353,20	brAAA	A2.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/21	LAME	1.067.706,79	brAAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/21	LAME	273.757,86	brAAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	836.730,39	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/21	LAME	273.757,86	brAAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	2.427.651,04	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	27/01/25	BRADESCO	10.406.443,50	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	CCR	5.331.972,01	-	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	ECORODOV	3.657.067,90	brAAA	A2.br	-	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/25	SABESP	1.192.130,93	brAAA	-	AA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/28	COMGAS	9.619.646,74	-	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	JAGUARA	1.718.951,39	-	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	ENERGMIR	1.035.698,62	-	-	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	01/08/25	BRADESCO	3.401.262,15	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/24	SONAE	374.206,56	-	-	AA+(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/24	SONAE	436.574,33	-	-	AA+(bra)	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/24	SONAE	436.574,33	-	-	AA+(bra)	
FIM EMB I A	28/05/21	28/11/23	BALFA	959.308,50	-	Aa1.br	AA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	591.241,42	brAA	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	145.736,86	brAA	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.083.673,41	-	-	AA-(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	447.874,26	brAA	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	3.346.383,49	-	-	AA-(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	656.706,09	-	-	AA-(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	602.522,42	-	-	AA-(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	1.380.353,22	brAA	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	1.639.835,92	brAA	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	3.434.887,53	brAA	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	674.181,10	brAA	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	618.493,03	brAA	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.343.755,03	-	-	AA-(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/09/34	BRKA	4.645.327,19	-	Aa3.br	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	3.783.420,43	brAAA	-	AA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/10/36	PAMPASUL	1.105.684,51	brAAA	-	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/10/38	TAUBATE	8.773.839,62	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/12/26	IRB	5.710.165,49	brAAA	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	970.418,83	brAAA	-	AA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.533.841,33	brAA	-	AA-(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/12/35	MS 306	786.373,36	-	-	A+(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/03/29	ANET	2.773.937,41	brA	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/03/31	LOCALIZA	3.302.791,45	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/03/29	CAGECE	2.394.535,72	-	-	AA-(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/03/28	BRISANET	3.072.337,22	brA+	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/10/36	PAMPASUL	1.041.645,57	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/03/24	BRADESCO	283.115,38	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/03/24	BRADESCO	283.115,38	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/03/24	BRADESCO	849.346,13	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	10/12/24	DASA	-	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	16/09/24	ITAUBB	1.115.012,42	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/03/27	GETI	1.965.409,29	-	Aa1.br	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	30/09/25	USIMINAS	5.115.870,85	brAA	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/10/25	ALUPAR	2.516.782,49	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	815.966,12	-	-	AA-(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	1.826.209,89	-	-	AA-(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	01/10/24	EQUATENE	-	brAA+	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	25/09/21	NATURA	3.960.538,37	brAA+	-	AA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/03/24	AMPL	1.532.538,19	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/10/25	ALUPAR	2.515.775,78	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	10/05/24	MULTIPLA	-	brAAA	-	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/02/23	GETI	4.022.426,78	-	Aa1.br	-	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/03/24	AMPL	2.570.709,23	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/10/25	ALUPAR	1.017.786,84	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	1.150.123,68	-	-	AA-(bra)	
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	839.279,44	-	-	AA-(bra)	



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/06/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB II	24/07/13	15/07/21	LAME	454.413,32	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	20/08/14	15/07/21	LAME	454.593,35	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	24/02/15	15/01/23	SABESP	2.738.094,46	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	04/03/15	02/03/22	B VOTORA	22.775.821,09	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB II	20/10/14	15/01/23	SABESP	1.069.286,47	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.032.166,10	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.031.156,94	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.134.538,76	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/06/15	15/04/23	RD COLIN	1.330.442,82	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	09/06/15	07/06/22	B VOTORA	10.586.660,68	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB II	30/06/15	28/06/22	B VOTORA	10.627.463,93	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB II	21/10/14	15/01/23	SABESP	5.340.354,30	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	12/08/15	16/07/23	DUKE GEP	4.015.058,24	-	Aaa.br	-
FI RF EMB II	06/11/15	04/11/22	BRADESCO	6.412.984,97	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	18/11/15	16/11/22	BRADESCO	15.915.979,84	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/04/22	ECPT	15.387,61	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/07/22	ECPT	48.528,53	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/10/22	ECPT	47.254,71	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/01/23	ECPT	46.030,93	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	11/02/16	15/01/23	ECPT	160.573,83	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/07/22	ECPT	423.277,27	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/10/22	ECPT	412.688,41	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/04/22	ECPT	61.801,16	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/04/22	ECPT	72.617,31	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/01/23	ECPT	772.542,77	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/24	TRANS AL	2.154.284,24	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	794.995,33	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	476.997,20	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/24	TRANS AL	1.587.691,71	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	28/07/16	04/10/21	B VOTORA	2.257.634,74	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	405.729,65	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	260.962,93	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/09/16	15/10/22	ECPT	1.104.538,22	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	10/10/16	15/01/23	SABESP	210.584,63	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FIM EMB II A	12/12/16	12/01/22	LOCALIZA	530.298,52	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	12/12/16	12/01/22	LOCALIZA	600.337,94	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/04/22	ECPT	263.828,22	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/07/22	ECPT	819.099,05	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/10/22	ECPT	804.800,91	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/01/23	ECPT	379.675,45	-	A2.br	-
FIM EMB I A	28/04/17	15/04/22	LAME	455.900,89	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/01/23	ECPT	715.023,08	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/07/22	ECPT	52.432,07	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/17	15/04/23	RD COLIN	2.458.937,93	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	25/08/17	15/08/24	PETR	16.210.892,35	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FIM EMB II A	22/09/17	15/09/22	ENERSUL	535.271,39	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	28/09/17	25/09/21	NATURA	629.624,05	brAA+	-	AA(bra)
FIM EMB II A	28/09/17	25/09/21	NATURA	1.117.074,93	brAA+	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/11/27	RB CAPIT	4.085.569,49	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/11/27	RB CAPIT	1.192.341,60	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	29/01/18	27/10/22	SUL AME	1.295.383,02	-	-	A+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/11/27	RB CAPIT	4.261.412,98	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.118.254,61	brAAA	-	-
FI RF EMB II	19/02/18	15/02/25	SABESP	8.179.210,33	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.076.093,51	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB II A	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.511.154,88	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	11.154.107,71	brAA	-	-
FI RF EMB II	23/05/18	15/05/28	COMGAS	24.850.754,07	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	548.474,56	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	548.474,56	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	548.474,56	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	547.027,84	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	548.474,56	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	10.351.301,22	-	A2.br	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/06/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	454.883,83	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	27/11/25	GUAR	-	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.312.976,25	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/03/31	LOCALIZA	15.853.398,97	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	04/11/25	BCBF	1.031.478,14	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/05/30	NORTE EN	2.002.462,56	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.597.334,60	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	09/06/21	15/11/25	QUATA	4.196.096,00	-	-	A-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	15/12/35	MS 306	2.436.708,91	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	1.003.771,99	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	20/08/26	VAMOS	501.702,29	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	420.673,33	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	803.017,60	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	501.298,38	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	501.298,38	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	20/08/26	VAMOS	1.032.737,98	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	499.496,67	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	1.015.237,13	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	1.000.008,57	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	1.708.550,30	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	426.640,33	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	200.754,40	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	502.417,09	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	1.502.863,65	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	19/06/24	BNBBM	534.268,67	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	12/06/24	BNBBM	808.213,22	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	723.871,53	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	10/09/22	CBD	2.546.591,48	brAA-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	1.733.213,51	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/09/25	BRKA	1.881.565,58	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/09/25	BRKA	625.421,80	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	10/09/22	CBD	967.704,76	brAA-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	25/04/23	CELPA	2.505.234,72	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/12/30	B2W	3.263.566,46	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/09/34	BRKA	1.001.195,79	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/10/36	PAMPASUL	3.885.101,67	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	13/07/23	ECORODOV	2.109.896,69	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	15/05/23	LIGHT	2.020.487,54	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	15/03/29	OMEGA GE	2.041.299,90	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	20/04/26	SMARTIFI	2.048.811,33	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	30/09/23	USIMINAS	2.034.032,17	brAA+	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	30/09/23	USIMINAS	508.508,04	brAA+	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/31	CORSAN	1.533.519,09	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/26	CORSAN	1.020.884,12	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	18/06/21	15/12/30	MG050	501.975,32	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	21/06/21	15/04/28	PAMPASUL	1.314.634,21	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	22/06/21	15/06/31	RIO PR	495.827,37	-	Aaa.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	27/11/25	GUAR	2.000.019,15	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAME	297.190,77	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	1.553.873,75	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAME	1.540.539,90	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	84.928,32	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	20/06/26	OURO VER	2.001.533,41	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/06/21	15/09/34	BRKA	1.692.629,34	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/06/21	27/11/25	GUAR	1.326.543,31	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/06/21	15/12/35	MS 306	3.145.493,43	-	-	A+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SN5	700.163,89	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SN3	6.329.190,78	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SN6	1.400.354,99	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC	4.373.674,11	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CELG DIST SN B	6.385.084,61	-	-	AA-sf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CREDZ SN4	14.191,83	brAA(sf)	-	Asf(bra)



Observação: Em Junho 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 **3.791.975.831,53**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.718.418.522,39	3.791.975.831,53	71,69%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACE	100,00%	2.086.328.185,53	3.791.975.831,53	55,02%	Enquadrado
% do PL em Títulos RFI, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	632.090.336,86	3.033.580.710,43	16,67%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	758.395.177,61	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	379.197.588,80	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	947.993.957,88	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	947.993.957,88	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	827.729.262,86	2.654.383.036,87	21,83%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	947.993.957,88	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	99.873.858,21	758.395.177,61	2,63%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	31.418.560,15	568.796.397,33	0,83%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	758.395.177,61	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	107.751.993,20	379.197.588,80	2,84%	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 JUNHO DE 2021 À 30 DE JUNHO DE 2021											
												
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
07/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENACEP	NTN-B	15/05/2023	Venda	1,8870%	1,9268%	1,4947%	2,8623%	-0,0398%	NÃO
07/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENACEP	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,0459%	3,0600%	2,5637%	3,9689%	-0,0141%	NÃO
07/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	NECTON	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,0459%	3,0600%	2,5637%	3,9689%	-0,0141%	NÃO
08/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	1,9368%	1,9645%	1,5916%	2,9589%	-0,0277%	NÃO
08/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP_INV	NTN-B	15/05/2023	Venda	1,9205%	1,9645%	1,5916%	2,9589%	-0,0440%	NÃO
08/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP_INV	NTN-B	15/05/2023	Venda	1,9305%	1,9645%	1,5916%	2,9589%	-0,0340%	NÃO
08/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	1,9305%	1,9645%	1,5916%	2,9589%	-0,0340%	NÃO
08/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	MERRILL	NTN-B	15/05/2023	Venda	1,9300%	1,9645%	1,5916%	2,9589%	-0,0345%	NÃO
08/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	CONVENÇÃ	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,0359%	3,0501%	2,6433%	4,0486%	-0,0142%	NÃO
08/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENACEP	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,0595%	3,0501%	2,6433%	4,0486%	0,0094%	NÃO
08/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	CONVENÇÃ	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,0595%	3,0501%	2,6433%	4,0486%	0,0094%	NÃO
08/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	NECTON	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,0595%	3,0501%	2,6433%	4,0486%	0,0094%	NÃO
14/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENACEP	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,1939%	3,2088%	2,8069%	4,2126%	-0,0149%	NÃO
14/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	NECTON	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,1939%	3,2088%	2,8069%	4,2126%	-0,0149%	NÃO
15/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	NECTON	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,2484%	3,2680%	2,7927%	4,1986%	-0,0196%	NÃO
15/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,2095%	3,2680%	2,7927%	4,1986%	-0,0585%	NÃO
15/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	NECTON	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,2095%	3,2680%	2,7927%	4,1986%	-0,0585%	NÃO
15/06/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP_INV	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,2095%	3,2680%	2,7927%	4,1986%	-0,0585%	NÃO
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
01/06/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2055	Venda	4,4510%	4,3957%	4,0774%	4,9617%	0,0553%	NÃO
17/06/2021	FIM EMB II A	BNP	GENIAL	LTN	01/01/2024	Venda	7,9630%	8,0340%	7,0911%	9,2394%	-0,0710%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO												
Cliente:	EMBRAER PREV											
Período:	01 DE JUNHO DE 2021 À 30 DE JUNHO 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
02/06/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	LFT	01/09/2024	Compra	0,2444%	0,2412%	0,1815%	0,3107%	0,0032%	NÃO
15/06/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	LFT	01/03/2025	Compra	0,2598%	0,2612%	0,2042%	0,3223%	-0,0014%	NÃO
16/06/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	LFT	01/09/2025	Compra	0,2683%	0,2676%	0,2188%	0,3484%	0,0007%	NÃO
18/06/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	LFT	01/09/2024	Compra	0,2347%	0,2353%	0,1760%	0,3004%	-0,0006%	NÃO
25/06/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	LFT	01/03/2025	Compra	0,2572%	0,2542%	0,2011%	0,3203%	0,0030%	NÃO
25/06/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/05/2055	Compra	4,3990%	4,4365%	4,0365%	4,9273%	-0,0375%	NÃO
30/06/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	LFT	01/03/2024	Compra	0,2332%	0,2255%	0,1198%	0,2902%	0,0077%	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
10/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2022	Compra	1,4390%	1,5269%	1,0816%	2,4622%	-0,0879%	NÃO
10/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/05/2023	Compra	1,9990%	2,1371%	1,6900%	3,0568%	-0,1381%	NÃO
10/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	NTN-B	15/08/2024	Compra	2,8090%	2,9169%	2,4329%	3,8416%	-0,1091%	NÃO
10/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,0790%	3,1700%	2,6686%	4,0741%	-0,0970%	NÃO
10/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	NTN-B	15/08/2028	Compra	3,6590%	3,7140%	3,2472%	4,4530%	-0,0550%	NÃO
11/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	NTN-B	15/08/2026	Compra	3,3615%	3,4937%	2,9937%	4,3386%	-0,1322%	NÃO
11/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2026	Compra	3,4190%	3,4937%	2,9937%	4,3386%	-0,0747%	NÃO
14/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2026	Compra	3,4285%	3,4900%	3,0675%	4,4127%	-0,0615%	NÃO
15/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	NTN-B	15/08/2026	Compra	3,4900%	3,5200%	3,0638%	4,4093%	-0,0300%	NÃO
15/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2028	Compra	3,7790%	3,7938%	3,3746%	4,5816%	-0,0148%	NÃO
16/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,2690%	3,2793%	2,8520%	4,2581%	-0,0103%	NÃO
17/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,2410%	3,5692%	2,8634%	4,2696%	-0,3282%	NÃO
17/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	NTN-B	15/05/2025	Venda	3,2410%	3,5692%	2,8634%	4,2696%	-0,3282%	NÃO
17/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	ATIVA	NTN-B	15/08/2028	Venda	3,7910%	3,9836%	3,4135%	4,6212%	-0,1926%	NÃO
18/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/05/2023	Venda	2,6230%	2,7067%	2,2891%	3,6546%	-0,0837%	NÃO
21/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/08/2026	Compra	3,8690%	3,7943%	3,4301%	4,7770%	0,0747%	NÃO
22/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2024	Venda	3,2860%	3,4644%	2,9211%	4,3293%	-0,1784%	NÃO
22/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2024	Venda	3,2710%	3,4644%	2,9211%	4,3293%	-0,1934%	NÃO
22/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2026	Venda	3,8410%	3,8845%	3,3682%	4,7149%	-0,0435%	NÃO
22/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2026	Venda	3,8410%	3,8845%	3,3682%	4,7149%	-0,0435%	NÃO
22/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2026	Venda	3,8410%	3,8845%	3,3682%	4,7149%	-0,0435%	NÃO
22/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2026	Venda	3,8410%	3,8845%	3,3682%	4,7149%	-0,0435%	NÃO
23/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2026	Venda	3,8910%	3,8428%	3,4584%	4,8055%	0,0482%	NÃO
23/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2026	Venda	3,8810%	3,8428%	3,4584%	4,8055%	0,0382%	NÃO
23/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2026	Venda	3,8910%	3,8428%	3,4584%	4,8055%	0,0482%	NÃO
24/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2024	Compra	3,4600%	3,3971%	3,0715%	4,4794%	0,0629%	NÃO
25/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/05/2023	Compra	2,6790%	2,6354%	2,3426%	3,7067%	0,0436%	NÃO
25/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2024	Venda	3,4100%	3,3600%	3,0094%	4,4173%	0,0500%	NÃO
25/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2028	Venda	3,9350%	3,9228%	3,5198%	4,7296%	0,0122%	NÃO
25/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2050	Compra	4,3390%	4,3827%	3,9732%	4,8779%	-0,0437%	NÃO
29/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2026	Compra	3,6800%	3,6830%	3,2337%	4,5821%	-0,0030%	NÃO
29/06/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2050	Compra	4,4090%	4,3759%	3,9982%	4,9010%	0,0331%	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.