



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Junho/2022





1. INTRODUÇÃO

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pela EMBRAER PREV, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador, referentes aos riscos de mercado, de crédito, operacionais, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência.

Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento dos Planos administrados pela EMBRAER PREV, bem como na Resolução CMN Nº 4.661/2018.

2. RISCO DE MERCADO

Para o acompanhamento do risco de mercado da carteira de investimentos da EMBRAER PREV, a Entidade adotará a metodologia de avaliação de risco conhecida como o Valor em Risco (*VaR*), que indica a probabilidade de perda de uma carteira de investimentos para um determinado intervalo de confiança e prazo. O intervalo de confiança e prazos a serem utilizados serão definidos em Política de Investimento. Quando não houver essa definição, a Entidade deverá usar um intervalo de confiança de 95% e prazo de 21 dias úteis (um mês). O *VaR* poderá ser calculado de forma absoluta ou relativa. Para as carteiras de renda variável o *tracking error (TE)* pode ser empregado como uma alternativa ao *VaR*. Os seguintes relatórios elaborados pelo administrador são utilizados pela EMBRAER PREV para o controle de risco de mercado:

2.1. Relatório Detalhado Risco



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.932.009.925,11	VAR / PL:	2,128%
VAR:	83.692.344,18	ETL / PL:	2,6692%
ETL:	104.953.612,04	VAR / CDI:	4340,53%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(141.185.843,00)	BAIXA 1:	277.759.290,03	Cenário 1:	289.809.456,10
				Cenário 2:	(75.787.377,07)
				Cenário 3:	(483.976.808,62)

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	226.065,07	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	23.329.076,72	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	8.750.522,28	713.068,34	486.494,68	0,58%	643.201,45	2.420,08	(804.043,77)
AIEC11	3.468.868,76	212.402,73	160.027,04	0,19%	115.896,15	-	(151.509,07)
ALPA4	207.495,26	29.830,04	15.289,18	0,02%	22.401,92	82,95	(26.984,72)
ALSO3	2.412.930,00	286.260,78	261.999,35	0,31%	381.023,28	1.379,64	(435.880,11)
AMER3	1.727.658,24	682.325,33	541.327,93	0,65%	1.099.848,90	-	(843.098,80)
ASAI3	602.881,50	91.450,28	80.184,48	0,10%	46.716,42	-	(58.145,07)
AURE3	9.016.353,72	1.563.837,37	(689.901,42)	-0,82%	-	-	-
AZUL4	218.851,74	84.761,63	70.623,14	0,08%	135.000,31	410,35	(104.935,34)
B3SA3	10.645.622,85	1.578.513,23	938.356,61	1,12%	781.601,01	2.940,93	(977.142,49)
Banco BTG Pactual SA UNT	14.231.821,66	1.900.784,92	1.600.643,30	1,91%	2.142.957,26	7.784,55	(2.469.765,99)
BBAS3	10.660.724,68	1.585.636,97	1.225.117,58	1,46%	1.544.134,45	5.623,55	(1.790.047,13)
BBDC3	1.180.529,28	152.854,38	126.116,66	0,15%	152.078,56	557,84	(179.230,03)
BBDC4	18.617.156,80	2.632.412,01	2.212.744,03	2,64%	2.656.655,76	9.684,45	(3.086.505,71)
BBSE3	3.431.697,36	306.374,73	233.102,36	0,28%	156.298,04	595,93	(201.538,08)
BEEF3	1.375.973,88	152.317,85	94.202,60	0,11%	(17.477,60)	(68,57)	24.111,23
BLCP11	1.330.503,30	51.614,39	15.860,97	0,02%	(3.503,45)	-	4.775,66
BMGB4	161.200,00	15.659,45	12.173,95	0,01%	15.863,97	59,00	(19.304,28)
BMLC11	2.107.874,91	89.722,44	(21.309,08)	-0,03%	(52.752,41)	-	73.862,10
BPAN4	110.552,40	22.265,19	16.706,91	0,02%	32.123,08	110,00	(32.384,62)
BPML11	1.006.912,00	95.660,60	28.085,80	0,03%	54.237,73	205,98	(69.287,82)
BRAP4	348.500,24	50.417,61	31.607,39	0,04%	41.009,79	151,19	(48.896,58)
BRFS3	804.594,28	183.740,89	78.221,48	0,09%	103.968,68	381,30	(122.480,45)
BRKM5	534.502,80	90.213,18	56.055,15	0,07%	110.595,76	392,04	(120.540,83)
BRML3	8.566.618,56	923.529,96	561.691,04	0,67%	1.084.417,87	3.981,74	(1.280.995,92)
CASH3	32.344,48	13.889,44	12.300,65	0,01%	23.421,97	-	(16.916,06)
CCRO3	755.559,52	80.265,04	67.329,34	0,08%	57.901,55	217,54	(72.133,69)
CEOC11	854.915,70	59.513,28	32.007,32	0,04%	24.320,56	93,50	(31.974,54)
CIEL3	1.227.316,86	218.048,57	170.685,58	0,20%	23.057,69	89,06	(30.653,09)
CLSA3	107.045,00	26.783,64	(4.160,20)	0,00%	15.757,15	-	(18.222,66)
CMIG4	795.572,69	122.407,76	110.126,35	0,13%	95.759,05	352,60	(113.853,86)
CMIN3	244.159,44	48.226,84	15.130,51	0,02%	23.477,50	-	(28.637,85)
CNES11	509.780,70	39.051,04	19.527,59	0,02%	23.421,52	89,28	(30.187,27)
CNRD11	78.302,00	-	-	0,00%	-	-	-
COGN3	206.687,62	54.261,27	51.098,90	0,06%	54.712,39	189,32	(56.470,71)
CPFE3	4.735.475,79	972.046,41	637.241,68	0,76%	756.137,81	2.735,75	(863.460,86)
CPL66	565.720,95	63.555,96	50.815,29	0,06%	62.808,21	232,25	(75.412,81)
CRFB3	360.591,40	79.484,72	64.713,51	0,08%	70.426,28	250,89	(77.629,31)
CSAN3	1.149.241,59	203.134,88	148.670,12	0,18%	164.173,00	598,43	(190.706,31)
CSED3	954.970,00	169.513,88	100.077,32	0,12%	157.026,76	-	(178.458,72)
CSNA3	561.165,00	148.583,15	110.475,25	0,13%	174.727,95	593,36	(172.911,42)
CVCB3	85.409,66	31.338,89	25.488,37	0,03%	33.057,83	109,01	(30.655,38)
CYRE3	663.223,06	128.655,65	103.760,03	0,12%	138.619,58	490,95	(150.779,29)
DXCO3	157.302,60	16.445,54	8.434,99	0,01%	16.266,13	-	(19.688,62)
ECOR3	102.988,25	25.032,11	20.462,68	0,02%	20.701,74	73,57	(22.692,69)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.932.009.925,11	VAR / PL:	2,128%
VAR:	83.692.344,18	ETL / PL:	2,6692%
ETL:	104.953.612,04	VAR / CDI:	4340,53%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(141.185.843,00)	BAIXA 1:	277.759.290,03	Cenário 1:	289.809.456,10
				Cenário 2:	(75.787.377,07)
				Cenário 3:	(483.976.808,62)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
EGIE3	561.422,18	54.509,78	46.627,15	0,06%	40.839,73	153,72	(51.094,87)
ELET3	13.770.178,20	1.362.323,79	878.395,79	1,05%	248.614,04	960,65	(330.789,83)
ELET6	7.072.668,38	639.634,14	312.754,62	0,37%	(17.162,74)	(66,99)	23.389,36
ENBR3	251.014,26	26.733,79	21.579,20	0,03%	18.554,64	69,80	(23.184,00)
ENEV3	8.066.809,05	978.953,84	807.590,10	0,96%	462.152,76	1.752,24	(588.144,69)
ENGI11	533.987,78	58.441,78	35.926,67	0,04%	26.625,33	101,31	(34.166,02)
ENJU3	146.988,00	70.326,59	55.986,34	0,07%	127.663,55	-	(84.132,89)
EQTL3	18.444.426,10	1.193.070,60	641.152,87	0,77%	422.281,84	1.627,84	(558.730,35)
ESPA3	66.220,00	22.781,16	14.279,75	0,02%	16.382,11	-	(17.182,06)
EUCATEX PN	127.641,00	36.028,23	30.362,39	0,04%	38.957,04	132,62	(38.763,22)
EZTC3	1.068.119,31	167.602,98	142.769,98	0,17%	184.591,99	664,03	(208.034,00)
FLRY3	225.468,36	24.257,66	10.839,17	0,01%	20.522,08	76,59	(25.171,15)
GALG11	2.151.749,28	36.930,39	12.169,38	0,01%	19.088,12	-	(25.670,10)
GGBR4	8.135.584,34	1.967.997,19	1.705.439,55	2,04%	2.403.354,22	8.213,65	(2.412.403,38)
GGPS3	2.907.420,64	562.678,38	480.449,45	0,57%	728.154,83	-	(761.538,11)
GMAT3	4.551.448,60	1.141.953,53	948.668,21	1,13%	1.805.840,53	5.933,31	(1.661.147,57)
GOAU4	363.135,36	89.156,86	75.045,93	0,09%	105.947,78	362,62	(106.696,16)
GOLL4	84.054,66	32.950,46	28.820,68	0,03%	51.425,97	156,58	(40.116,58)
HAPV3	8.591.670,46	1.531.069,34	479.913,23	0,57%	1.198.529,08	4.375,31	(1.397.029,76)
HBRH11	1.917.316,80	52.111,27	15.801,74	0,02%	32.918,19	-	(43.843,76)
HSML11	8.571.899,67	526.729,49	270.303,67	0,32%	77.059,16	299,09	(103.616,38)
HYPE3	5.200.619,60	657.328,12	590.274,02	0,71%	362.278,44	1.365,56	(454.783,72)
IGTI11	1.464.521,04	235.529,69	178.751,64	0,21%	-	-	-
INTB3	1.769.556,00	128.856,94	70.659,49	0,08%	113.067,45	-	(142.842,46)
IRBR3	140.655,64	33.281,37	21.912,74	0,03%	21.741,52	78,84	(24.955,75)
ITSA4	12.486.872,02	1.306.013,35	1.123.886,71	1,34%	1.404.916,82	5.191,56	(1.684.216,97)
ITUB4	25.333.046,52	3.217.003,08	2.838.199,23	3,39%	3.362.331,38	12.311,69	(3.946.647,84)
JBSS3	9.259.238,10	724.507,57	529.190,61	0,63%	745.385,49	2.795,38	(924.698,88)
JHSF3	98.484,48	21.775,87	17.696,49	0,02%	16.825,01	60,58	(18.999,16)
KLBN11	865.105,92	95.197,52	64.796,71	0,08%	108.183,02	397,50	(127.998,09)
LCAM3	1.937.402,88	226.459,59	191.420,30	0,23%	238.687,34	877,75	(282.951,39)
LREN3	9.904.366,60	1.689.182,66	1.495.322,77	1,79%	1.774.396,82	6.365,44	(1.987.194,19)
LVBH11	3.497.392,08	105.567,00	71.899,90	0,09%	51.155,03	198,00	(68.334,63)
LWSA3	2.168.978,24	641.633,47	303.890,84	0,36%	496.179,21	1.742,71	(529.605,66)
MALL11	5.050.505,79	123.522,53	58.612,61	0,07%	(17.370,66)	(67,84)	23.701,09
MATD3	1.267.747,80	228.034,32	138.859,47	0,17%	220.780,58	-	(248.488,57)
MAXR11	1.330.899,35	77.583,79	62.562,32	0,07%	88.497,08	334,08	(111.481,80)
MDNE3	85.305,00	19.292,16	16.901,97	0,02%	21.237,22	73,97	(22.241,72)
MGLU3	368.954,13	121.532,94	104.243,44	0,12%	195.848,22	613,00	(162.092,86)
MOVH3	804.756,00	214.748,02	183.632,31	0,22%	247.605,60	842,07	(245.833,68)
MRFG3	228.578,70	33.469,58	17.035,10	0,02%	37.460,94	135,29	(42.597,12)
MRVE3	303.015,57	52.131,12	47.965,86	0,06%	72.990,01	255,07	(77.021,92)
MULT3	4.599.870,30	633.362,86	450.001,10	0,54%	400.539,02	1.497,53	(493.369,11)
NEWU11	413.617,86	82.147,21	53.477,11	0,06%	77.119,77	-	(85.748,42)
NEXP3	14.784,00	-	-	0,00%	-	-	-
NINJ3	231.171,00	81.610,86	69.397,94	0,08%	106.951,59	-	(93.283,90)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.932.009.925,11	VAR / PL:	2,128%
VAR:	83.692.344,18	ETL / PL:	2,6692%
ETL:	104.953.612,04	VAR / CDI:	4340,53%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(141.185.843,00)	BAIXA 1:	277.759.290,03	Cenário 1:	289.809.456,10
				Cenário 2:	(75.787.377,07)
				Cenário 3:	(483.976.808,62)

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	5.832.903,98	1.356.077,77	999.440,26	1,19%	1.278.997,11	4.510,15	(1.377.547,75)
ONCO3	615.120,00	143.406,94	88.807,51	0,11%	164.322,46	-	(169.225,48)
PACUCAR_CBD ON ED	137.639,79	26.431,37	23.407,46	0,03%	31.043,29	109,18	(33.236,10)
PARD3	498.708,00	87.134,18	68.846,31	0,08%	90.353,54	323,85	(100.987,06)
PATC11	8.486.064,30	273.729,67	(76.627,71)	-0,09%	(215.435,78)	(850,71)	301.777,58
PETR3	11.999.257,76	2.459.149,54	1.530.223,91	1,83%	1.990.522,96	7.182,20	(2.258.900,11)
PETR4	29.823.206,40	6.264.130,82	3.817.236,69	4,56%	4.847.950,35	17.517,94	(5.520.014,04)
PETZ3	2.267.877,25	376.986,08	146.114,41	0,17%	293.904,94	1.077,69	(346.100,21)
POSI3	23.357,10	6.262,16	5.660,75	0,01%	8.432,53	28,09	(7.992,97)
PRI03	11.114.830,44	2.616.941,35	1.743.411,80	2,08%	3.026.819,66	10.441,37	(3.102.372,58)
QAGR11	8.248.836,48	453.494,93	(99.167,07)	-0,12%	(133.876,12)	-	185.470,95
QUAL3	169.828,27	42.680,64	(18.297,32)	-0,02%	(27.720,86)	(117,95)	46.533,04
RADL3	4.479.579,90	740.121,09	110.349,24	0,13%	84.003,29	324,48	(111.679,16)
RAIL3	10.075.489,10	1.625.686,30	832.632,22	0,99%	292.917,43	1.125,76	(384.827,12)
RBRL11	2.994.767,16	79.190,62	24.075,46	0,03%	4.894,96	-	(6.638,96)
RCRB11	2.167.291,96	193.224,92	(27.959,53)	-0,03%	(106.069,57)	(423,95)	152.939,54
RDOR3	4.021.663,41	721.599,99	424.227,82	0,51%	718.044,34	-	(804.642,16)
RECV3	3.797.657,24	941.722,17	748.395,40	0,89%	820.839,14	-	(886.739,36)
RENT3	9.863.739,99	1.321.399,98	1.145.059,34	1,37%	1.472.787,26	5.353,07	(1.699.572,39)
RNGO11	122.137,08	7.956,21	5.040,51	0,01%	4.469,45	17,11	(5.821,72)
RRRP3	379.678,40	127.102,60	106.778,40	0,13%	136.663,90	455,36	(129.659,27)
SANB11	560.729,61	84.501,20	71.852,79	0,09%	76.142,04	278,42	(89.091,90)
SBSP3	750.535,68	146.843,30	122.054,19	0,15%	113.892,83	413,51	(131.105,48)
SDIL11	368.672,20	20.490,32	15.325,05	0,02%	7.039,31	27,19	(9.354,81)
SEER3	503.241,33	67.086,87	55.562,71	0,07%	89.702,98	321,93	(100.550,63)
SLCE3	234.911,71	47.471,56	28.453,38	0,03%	37.801,03	136,69	(43.112,42)
SOMA3	2.550.742,47	436.999,55	372.119,26	0,44%	405.417,21	1.467,30	(463.303,37)
SPY	9.880.166,73	705.346,17	(409.010,77)	-0,49%	(267.139,91)	(86.269,40)	374.953,79
STBP3	3.539.715,00	724.649,50	652.627,07	0,78%	768.903,12	2.713,74	(829.776,13)
SULA11	934.833,15	172.814,06	128.639,38	0,15%	152.830,19	552,02	(173.854,65)
SUZB3	11.934.690,05	1.295.031,48	714.814,38	0,85%	1.307.248,94	4.837,22	(1.572.063,37)
TAAE11	445.290,36	39.893,13	21.613,97	0,03%	10.689,05	41,18	(14.124,86)
TEND3	458.535,00	83.931,48	(5.465,22)	-0,01%	92.389,95	328,27	(101.228,32)
TEPP11	8.105.710,24	370.804,96	(70.942,27)	-0,08%	(144.456,51)	(568,25)	200.511,95
TIMS3	3.449.687,50	418.131,45	359.320,87	0,43%	457.128,41	1.674,00	(536.687,27)
TOTS3	3.373.987,11	656.188,67	435.755,75	0,52%	494.217,53	1.798,57	(571.968,62)
TRXF11	13.023.087,35	159.834,88	(69.692,63)	-0,08%	(129.221,66)	(506,30)	177.677,31
UGPA3	5.040.591,76	884.831,37	678.499,99	0,81%	882.171,33	3.170,39	(992.033,52)
URTH_US	4.001.814,54	433.594,06	(402.543,81)	-0,48%	(369.497,71)	(36.016,33)	563.074,55
USIM5	245.423,39	42.058,76	32.493,27	0,04%	70.059,96	240,40	(70.956,20)
VALE3	50.978.863,38	8.141.957,82	5.325.933,00	6,36%	6.792.457,45	24.865,86	(7.968.626,01)
VBBR3	6.813.927,90	803.183,89	734.160,13	0,88%	1.203.654,99	-	(1.351.359,81)
VIIA3	176.258,06	60.119,57	55.551,91	0,07%	88.574,63	-	(74.898,45)
VISC11	696.840,80	26.288,59	3.675,68	0,00%	(8.472,40)	(33,23)	11.680,52
VIVT3	1.002.008,70	115.569,70	90.829,11	0,11%	99.983,99	371,63	(121.488,85)
VTV_US	6.898.470,82	340.175,08	(211.502,84)	-0,25%	(67.845,73)	(62.086,24)	93.276,84



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.932.009.925,11	VAR / PL:	2,128%
VAR:	83.692.344,18	ETL / PL:	2,6692%
ETL:	104.953.612,04	VAR / CDI:	4340,53%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(141.185.843,00)	BAIXA 1:	277.759.290,03	Cenário 1:	289.809.456,10
				Cenário 2:	(75.787.377,07)
				Cenário 3:	(483.976.808,62)

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
VVPR11	1.383.802,00	48.211,62	12.235,15	0,01%	(2.942,31)	-	4.008,35
WEGE3	6.247.356,18	871.923,44	36.443,61	0,04%	4.727,63	18,42	(6.418,64)
XPIN11	3.191.280,05	91.242,85	14.418,21	0,02%	47.149,96	-	(62.973,70)
XPPR11	3.102.770,43	204.205,20	58.371,56	0,07%	54.368,04	-	(72.383,19)
YDUQ3	1.954.215,80	474.034,84	399.470,12	0,48%	681.716,79	2.281,25	(652.945,25)
INDQ22	-	413.648,98	277.674,14	0,33%	-	-	-
WINQ22	-	1.456.517,35	(1.362.742,21)	-1,63%	-	-	-
DIH22	-	3.767,24	(186,61)	0,00%	(18.402,29)	9.515,56	28.136,72
DIH22	-	275.696,73	79.221,06	0,09%	(1.789.641,05)	924.259,41	2.730.715,30
DAPQ22	-	152.871,22	101.744,45	0,12%	49.906,01	(18.051,59)	(108.067,91)
DIH22	-	667.206,97	(175.110,60)	-0,21%	6.441.896,40	(3.317.121,31)	(9.781.220,52)
DIH23	-	3.087,08	1.166,27	0,00%	34.522,31	(17.703,61)	(52.060,57)
DAPK23	-	386.357,37	150.252,96	0,18%	269.036,92	(97.247,84)	(581.570,06)
DIH23	-	9.411,00	(5.998,37)	-0,01%	(69.982,50)	35.610,56	104.182,42
DIH24	-	164.155,24	(117.353,21)	-0,14%	(863.994,84)	436.677,97	1.271.847,20
DIH24	-	3.975,24	2.804,71	0,00%	19.408,87	(9.779,53)	(28.425,79)
DIH24	-	7.942,22	5.513,76	0,01%	36.660,18	(18.412,66)	(53.406,26)
DAPQ24	-	250.769,75	80.937,92	0,10%	566.078,25	(203.392,67)	(1.206.556,22)
DIH25	-	434.639,49	305.430,62	0,36%	1.933.261,08	(964.706,18)	(2.786.250,76)
DAPK25	-	74.380,25	43.292,07	0,05%	-	-	-
DIH25	-	90.591,39	(67.872,21)	-0,08%	(393.980,54)	195.318,67	561.714,42
DIH26	-	52.691,61	(41.644,81)	-0,05%	(218.178,11)	107.371,36	307.315,10
DAPQ26	-	86.257,60	60.131,59	0,07%	-	-	-
DIH27	-	88.313,30	72.616,86	0,09%	353.466,92	(171.480,78)	(486.290,99)
DAPQ28	-	183.857,80	(146.325,33)	-0,17%	-	-	-
DIH29	-	106.975,95	92.885,69	0,11%	409.602,61	(192.988,44)	(537.163,39)
DAPQ30	-	1,17	(0,99)	0,00%	(3,92)	1,36	7,68
DIH31	-	14.378,65	12.576,37	0,02%	55.929,15	(25.582,61)	(69.895,02)
DIH33	-	1.567,15	1.374,28	0,00%	6.134,49	(2.724,08)	(7.307,70)
DAPK35	-	15.630,50	(13.086,68)	-0,02%	-	-	-
DOLN22	-	28.323,05	(26.298,36)	-0,03%	(24.157,37)	(2.342,72)	36.820,43
WDON22	-	28.323,05	26.298,36	0,03%	24.157,37	2.342,72	(36.820,43)
DOLQ22	-	142.244,97	131.918,51	0,16%	123.662,42	10.722,71	(189.255,28)
WDOQ22	-	284.489,94	(263.837,03)	-0,32%	(247.324,84)	(21.445,41)	378.510,57
COMPROMISSADA	530.667.577,25	8.292,43	410,77	0,00%	40.507,01	(20.945,59)	(61.934,35)
EMP AÇÃO PROVISÃO	22.993,34	13,79	10,83	0,00%	130,06	(59,10)	(164,24)
LTN	19.480.968,17	196.142,25	147.034,57	0,18%	911.562,33	(453.426,51)	(1.306.926,97)
DE252 AEGEA SA CDI - AEGP13	1.091.143,12	57,87	(32,14)	0,00%	49,03	(25,14)	(73,94)
DE252 AERIS CDI - AER111	169.086,72	35,55	20,63	0,00%	200,30	(100,90)	(293,27)
DE252 ALIANSCA CDI - ALSA0	4.083.766,58	16.791,14	13.493,14	0,02%	66.336,88	(32.435,60)	(92.437,17)
DE252 AUTOBAN CDI - ANHB10	836.288,83	83,47	33,37	0,00%	434,09	(217,97)	(632,23)
DE252 AUTOPIST CDI - APRB28	1.311.806,47	168,17	90,28	0,00%	853,98	(426,07)	(1.230,68)
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.750.177,22	97,81	(21,74)	0,00%	350,91	(178,45)	(521,90)
DE252 BCBF CDI - BCBF14	272.908,94	41,90	20,82	0,00%	243,20	(122,81)	(357,52)
DE252 BCBF CDI - BCBF15	2.618.191,30	450,01	238,29	0,00%	2.587,93	(1.305,71)	(3.798,88)
DE252 BKBR CDI - BKBR18	1.465.802,76	120,17	27,68	0,00%	659,05	(334,06)	(974,90)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.932.009.925,11	VAR / PL:	2,128%
VAR:	83.692.344,18	ETL / PL:	2,6692%
ETL:	104.953.612,04	VAR / CDI:	4340,53%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(141.185.843,00)	BAIXA 1:	277.759.290,03	Cenário 1:	289.809.456,10
				Cenário 2:	(75.787.377,07)
				Cenário 3:	(483.976.808,62)

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
DE252 BRASKEM CDI - BRKMB6	559.047,64	889,56	746,60	0,00%	3.761,18	(1.803,98)	(5.082,17)
DE252 BRKA CDI - BRKPA0	2.427.894,66	1.548,55	1.143,94	0,00%	7.334,30	(3.641,14)	(10.482,93)
DE252 BRML CDI - BRML17	3.252.396,32	2.143,70	(1.625,20)	0,00%	(9.197,93)	4.617,02	13.387,82
DE252 CCPR CDI - CCPRA3	2.184.204,98	1.699,61	(1.039,41)	0,00%	(4.265,11)	2.026,80	5.659,43
DE252 CEA MODA CDI - CEAB11	1.716.569,71	231,29	106,35	0,00%	1.351,02	(683,13)	(1.990,36)
DE252 CEA MODA CDI - CEAB22	549.337,50	305,76	226,22	0,00%	1.468,78	(728,77)	(2.097,51)
DE252 CELPA CDI - CELP15	2.583.037,26	140,52	(81,66)	0,00%	82,63	(42,50)	(125,25)
DE252 CONT GLO CDI - CGBP13	2.344.681,50	1.378,39	1.068,54	0,00%	6.372,04	(3.133,58)	(8.968,07)
DE252 COPEL GT CDI - CPGT14	304.023,55	112,09	(80,66)	0,00%	(793,16)	407,26	1.198,63
DE252 COPEL GT CDI - CPGT16	304.117,12	130,53	(97,73)	0,00%	(675,01)	343,41	1.004,60
DE252 CORSAN CDI - RSAN24	1.637.676,38	8.006,99	6.039,01	0,01%	33.492,70	(16.718,71)	(48.262,94)
DE252 COSAN LO CDI - RLOG11	1.587.720,42	226,62	108,03	0,00%	1.317,47	(665,60)	(1.938,21)
DE252 CSAN CDI - CSAN23	1.158.366,72	1.556,24	1.293,31	0,00%	6.641,83	(3.204,08)	(9.058,98)
DE252 DASA CDI - DASAA2	2.657.287,87	167,25	(2,84)	0,00%	777,26	(394,40)	(1.151,81)
DE252 ECORODOV CDI - ERDV18	1.816.598,34	13.095,05	11.277,12	0,01%	50.341,28	(23.977,29)	(67.200,81)
DE252 ECORODOV CDI - ERDVA0	2.203.986,24	124,73	(53,30)	0,00%	370,63	(190,06)	(558,90)
DE252 ELEKTRO CDI - ELEK27	558.572,45	148,70	(106,15)	0,00%	(1.095,86)	563,12	1.658,21
DE252 ELETROB CDI - ELET13	2.098.211,85	630,04	409,95	0,00%	3.209,45	(1.606,74)	(4.650,96)
DE252 ENERG TR CDI - ETEN13	7.604.052,54	58.551,67	49.928,82	0,06%	258.874,72	(124.346,42)	(350.733,46)
DE252 ENERSUL CDI - ESUL18	1.062.591,33	29,80	(23,31)	0,00%	(334,21)	172,82	510,98
DE252 EQUATENE CDI - EQTL13	1.477.024,38	114,32	21,61	0,00%	615,82	(312,26)	(911,48)
DE252 GUAR CDI - GUAR15	2.685.212,01	1.172,63	820,28	0,00%	5.857,42	(2.923,23)	(8.444,86)
DE252 GUARIROB CDI - GRRB14	1.109.540,88	132,64	63,69	0,00%	674,35	(337,89)	(978,65)
DE252 IGUATEMI CDI - IGTA37	2.166.464,83	1.468,39	(1.080,11)	0,00%	(6.485,73)	3.274,85	9.532,69
DE252 INTERVIA CDI - IVIA35	1.316.093,47	119,63	36,18	0,00%	655,47	(331,47)	(965,85)
DE252 LIGHT CDI - LIGHB4	2.114.758,65	144,47	4,46	0,00%	807,62	(411,21)	(1.203,58)
DE252 LIGHT CDI - LIGHD3	1.666.591,63	1.253,16	977,60	0,00%	5.674,38	(2.791,67)	(7.990,96)
DE252 LOCAMERI CDI - LCAMA9	2.018.522,68	493,82	299,56	0,00%	2.669,38	(1.342,71)	(3.898,71)
DE252 MOV_PART CDI - MOV127	1.212.828,06	1.474,85	1.180,92	0,00%	6.535,11	(3.201,26)	(9.138,51)
DE252 MOV_PART CDI - MOV133	1.532.490,47	80,03	(48,05)	0,00%	0,01	-	(0,01)
DE252 MULTIPLA CDI - MULP16	3.153.901,59	1.491,02	(1.116,30)	0,00%	(6.836,21)	3.467,44	10.123,26
DE252 OMEGA GE CDI - OMGE13	5.135.276,57	3.212,77	2.498,27	0,00%	14.727,58	(7.241,54)	(20.722,13)
DE252 OURO VER CDI - OVSA10	1.520.414,56	515,07	337,93	0,00%	2.671,45	(1.339,25)	(3.880,19)
DE252 PROLAGOS CDI - PRLG14	2.942.059,82	9.943,52	(7.198,52)	-0,01%	(52.587,90)	26.631,22	77.666,96
DE252 RD COLIN CDI - RDCO10	3.195.700,06	18.233,39	14.043,40	0,02%	73.551,54	(36.719,69)	(105.932,48)
DE252 RENNER CDI - LRENB1	1.431.364,29	121,06	30,07	0,00%	671,79	(340,32)	(992,78)
DE252 RT BANDE CDI - CBAN22	3.392.327,93	1.070,82	727,50	0,00%	5.404,78	(2.697,22)	(7.791,78)
DE252 S LUIZ A CDI - RDORB9	1.147.370,43	1.476,77	1.226,82	0,00%	6.307,61	(3.042,61)	(8.602,02)
DE252 SANEAMEN CDI - SNGO18	2.583.251,99	366,35	176,70	0,00%	2.116,57	(1.068,50)	(3.109,91)
DE252 SBF COME CDI - SBFC11	3.256.226,48	16.507,85	10.994,97	0,01%	72.308,72	(36.608,88)	(106.615,87)
DE252 SUL AME CDI - SULM15	665.760,86	23,18	(18,49)	0,00%	(346,89)	179,37	530,37
DE252 UNIGEL P CDI - UGEL11	883.201,36	314,35	214,70	0,00%	1.586,29	(792,21)	(2.289,63)
DE252 VAMOS CDI - VAMO22	1.122.199,06	259,20	160,12	0,00%	1.379,00	(691,90)	(2.005,75)
DE252 VERT-10 CDI - VCCS11	1.918.916,42	2.051,98	1.667,00	0,00%	8.934,94	(4.354,16)	(12.388,43)
DE252 VIX LOGI CDI - VIXL14	2.139.102,15	470,96	278,07	0,00%	2.616,49	(1.316,93)	(3.825,49)
LF selic	9.255.348,94	4.059,65	(3.046,41)	0,00%	(17.961,25)	9.331,63	27.680,21



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.932.009.925,11	VAR / PL:	2,128%
VAR:	83.692.344,18	ETL / PL:	2,6692%
ETL:	104.953.612,04	VAR / CDI:	4340,53%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(141.185.843,00)	BAIXA 1:	277.759.290,03	Cenário 1:	289.809.456,10
				Cenário 2:	(75.787.377,07)
				Cenário 3:	(483.976.808,62)

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
LF252 ABC CDI - LF002100BMM	1.106.972,62	57,81	(34,71)	0,00%	0,01	-	(0,01)
LF252 ABC CDI - LF002100BMX	1.106.972,62	57,81	(34,71)	0,00%	0,01	-	(0,01)
LF252 B.ALFA CDI - LF0021006S0	1.077.293,53	56,26	(33,78)	0,00%	0,01	0,00	(0,01)
LF252 BES INV CDI - LF00220018H	1.082.905,43	56,55	(33,96)	0,00%	0,01	-	(0,01)
LF252 CNH CDI - LF0021003Q1	2.061.313,74	107,65	(64,63)	0,00%	0,01	(0,00)	(0,02)
LF252 DAYCOVAL CDI - LF002100HDP	1.282.989,00	67,00	(40,23)	0,00%	0,01	0,00	(0,01)
LF252 DAYCOVAL CDI - LF002100HDQ	2.337.271,52	122,06	(73,29)	0,00%	0,01	-	(0,02)
LF252 LAGE CDI - LF002200IO9	2.043.606,28	106,72	(64,08)	0,00%	0,01	(0,00)	(0,02)
LF252 PANAMERI CDI - LF002100E1F	1.104.965,44	57,70	(34,65)	0,00%	0,01	-	(0,01)
LF252 PARANA B CDI - LF002100BC4	1.669.321,76	87,18	(52,34)	0,00%	0,01	0,00	(0,01)
LFSN BRADESCO CDI - LFSN210029N	3.637.907,56	189,98	(114,07)	0,00%	0,02	-	(0,03)
LFT	72.583.458,63	48.437,03	(6.304,93)	-0,01%	0,41	0,00	(0,56)
LFV TOYOTA CDI - LF002100ISJ	2.396.175,10	125,14	(75,13)	0,00%	0,01	-	(0,02)
CRI RB CAPIT IPCA M D - 17H0164854	7.004.597,29	63.094,40	34.488,85	0,04%	164.035,56	(58.154,28)	(333.278,86)
DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23	12.818.280,97	97.682,06	34.634,35	0,04%	248.354,80	(89.151,93)	(517.128,98)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.569.117,97	47.910,90	15.401,72	0,02%	80.421,07	(28.867,20)	(169.860,40)
DE252 CEMIG - IPCA CMDT33	1.961.573,75	21.100,39	8.783,89	0,01%	32.286,02	(11.609,75)	(68.947,56)
DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17	35.651.825,11	421.087,96	264.935,63	0,32%	1.438.997,02	(4.254,08)	(37.825.551,10)
DE252 CSAN IPCA - CSAN33	3.044.338,41	42.189,54	34.349,42	0,04%	153.287,65	(51.424,39)	(288.530,93)
DE252 CSMG IPCA - CSMGC3	12.837.485,61	123.042,29	46.604,06	0,06%	203.313,78	(73.059,41)	(426.953,04)
DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24	15.252.413,52	97.010,34	21.331,78	0,03%	85.352,66	(30.862,76)	(184.648,33)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	14.914.786,10	135.455,67	51.158,73	0,06%	332.669,96	(119.765,95)	(693.022,50)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36	3.046.078,65	31.940,60	10.267,82	0,01%	53.614,04	(19.244,80)	(113.240,26)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	1.043.687,13	16.120,26	7.368,21	0,01%	8.669,31	(3.130,47)	(18.696,94)
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	662.329,32	2.779,86	(328,90)	0,00%	302,19	(110,03)	(664,52)
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	1.079.843,94	14.613,54	7.852,82	0,01%	6.218,45	(2.243,24)	(13.381,43)
DE252 IRB IPCA - IRBR12	9.106.364,30	82.924,79	47.927,43	0,06%	289.716,35	(102.888,21)	(582.971,23)
DE252 LIGHT IPCA - LIGHD7	4.990.955,82	44.487,59	25.813,71	0,03%	142.690,40	(50.061,42)	(293.064,00)
DE252 LOCALIZA IPCA - LORTA7	8.429.287,04	123.542,41	101.238,98	0,12%	441.811,92	(146.718,81)	(831.806,85)
DE252 LOCAMERI IPCA - LCAMD1	8.753.865,78	123.749,23	101.853,48	0,12%	455.256,48	(155.465,93)	(846.169,29)
DE252 MOV_PART IPCA - MOV137	1.151.940,36	16.269,77	13.488,07	0,02%	60.659,95	(21.211,62)	(110.993,62)
DE252 MOVIDA L IPCA - MVLV16	6.346.361,21	93.840,09	72.761,65	0,09%	360.383,27	(126.539,26)	(728.134,35)
DE252 PETR IPCA - PETR45	15.017.801,75	157.637,57	52.009,36	0,06%	212.446,01	(76.245,19)	(453.166,04)
DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34	3.068.751,34	45.363,73	18.595,55	0,02%	29.890,97	(10.802,93)	(64.592,46)
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	5.226.543,12	80.726,54	36.898,29	0,04%	43.413,87	(15.676,65)	(93.629,94)
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	12.961.477,73	126.134,06	46.245,94	0,06%	249.616,01	(89.576,44)	(526.730,48)
DE252 SIMPAR IPCA M D - JSMLB5	2.824.274,11	39.884,00	33.126,52	0,04%	149.228,58	(52.512,18)	(271.889,95)
DE252 TRANS AL - IPCA TAE333	12.061.431,20	131.029,28	56.183,43	0,07%	162.648,08	(58.543,36)	(348.128,97)
DE252 VAMOS IPCA - VAMO33	6.458.505,25	91.960,71	74.638,49	0,09%	342.150,20	(116.698,96)	(639.574,58)
DE252 VAMOS IPCA - VAMO34	2.282.074,55	32.777,70	27.084,85	0,03%	123.436,03	(43.185,28)	(225.298,47)
DEBI AESTUCAN IPCA - TCII11	7.787.061,16	115.950,67	83.967,66	0,10%	483.178,10	(157.393,02)	(855.717,72)
DEBI ANEMUS IPCA - ANEM11	11.690.205,07	162.339,59	122.921,95	0,15%	640.183,11	(217.230,48)	(1.122.892,16)
DEBI ANET IPCA - ANET11	5.883.019,67	56.371,20	34.750,84	0,04%	166.307,42	(57.961,97)	(335.469,13)
DEBI B2W IPCA - BTOW15	6.460.501,61	96.990,33	79.670,84	0,10%	359.894,95	(123.937,63)	(661.434,63)
DEBI BRISANET IPCA - BRST11	5.892.613,41	54.685,03	34.323,23	0,04%	187.273,22	(65.504,84)	(377.324,59)
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	6.763.458,03	97.547,22	74.876,73	0,09%	373.270,10	(117.449,15)	(706.872,89)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.932.009.925,11	VAR / PL:	2,128%
VAR:	83.692.344,18	ETL / PL:	2,6692%
ETL:	104.953.612,04	VAR / CDI:	4340,53%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(141.185.843,00)	BAIXA 1:	277.759.290,03	Cenário 1:	289.809.456,10
				Cenário 2:	(75.787.377,07)
				Cenário 3:	(483.976.808,62)

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
DEBI CAGECE IPCA - CAEC21	4.848.764,30	57.324,09	24.326,39	0,03%	107.638,21	(21.012,03)	(279.255,64)
DEBI CART IPCA - CART13	6.417.312,02	88.055,58	69.818,77	0,08%	352.048,41	(120.059,93)	(642.011,23)
DEBI CEEE D IPCA - CEED21	4.029.334,54	48.421,10	37.817,92	0,05%	176.784,54	(59.866,70)	(342.785,02)
DEBI CELP IPCA - CEPEC1	2.091.601,53	30.074,51	24.528,35	0,03%	110.778,38	(37.224,37)	(207.587,78)
DEBI COELBA IPCA - CEEBC3	2.086.056,24	29.996,71	24.453,92	0,03%	110.409,88	(37.050,82)	(207.072,16)
DEBI COMGAS IPCA - GASP19	3.470.369,91	45.847,02	37.419,92	0,04%	161.820,52	(53.394,23)	(307.938,03)
DEBI CORSAN IPCA - RSAN44	5.530.162,12	59.765,58	42.989,28	0,05%	209.773,44	(70.615,42)	(414.422,13)
DEBI ECHOENER IPCA - ECHP22	1.470.056,99	15.583,17	10.603,70	0,01%	54.607,37	(18.490,24)	(108.832,10)
DEBI EDPM IPCA - MGSP12	4.830.227,48	60.723,27	43.254,49	0,05%	239.673,39	(74.572,07)	(447.218,18)
DEBI ELETROB IPCA - ELET42	10.789.095,08	122.387,48	90.200,65	0,11%	454.116,37	(154.332,17)	(894.327,25)
DEBI ENERGISA IPCA - ENGIA5	2.959.541,80	42.544,25	34.759,79	0,04%	157.169,71	(53.093,65)	(293.533,22)
DEBI ENERGMIR IPCA - ENMI21	896.830,67	8.123,56	4.208,43	0,01%	23.707,99	(8.429,83)	(48.253,82)
DEBI ENSINOP IPCA - CSNP12	1.661.131,08	19.534,55	15.000,37	0,02%	73.744,55	(26.094,83)	(137.724,56)
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	24.132.486,15	290.494,89	229.300,63	0,27%	1.079.240,86	(381.395,70)	(2.042.172,06)
DEBI GBS PART IPCA - GBSP11	6.400.782,24	111.232,02	84.034,25	0,10%	462.508,43	(153.335,43)	(763.119,73)
DEBI HAZTEC IPCA - HZTC14	2.146.262,65	28.567,53	22.404,67	0,03%	114.113,44	(38.873,60)	(208.542,19)
DEBI HIDRO BR IPCA - HBSA21	4.113.429,31	59.134,38	48.297,44	0,06%	218.330,86	(73.676,79)	(408.032,55)
DEBI HOLDARAG IPCA - HARG11	11.880.606,22	166.847,03	128.274,44	0,15%	677.749,39	(227.563,29)	(1.211.108,59)
DEBI IGUA SAN IPCA - IGSN15	2.205.273,31	26.073,82	19.922,20	0,02%	101.937,16	(34.352,68)	(190.081,45)
DEBI IP SUL C IPCA - IPIL11	4.540.293,76	49.965,84	36.947,88	0,04%	175.279,45	(60.776,42)	(324.927,76)
DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21	1.454.406,36	13.251,53	6.738,14	0,01%	37.206,71	(13.238,31)	(75.878,12)
DEBI LAME IPCA - LAMEA6	6.744.023,76	99.453,27	82.290,75	0,10%	364.223,55	(126.794,12)	(667.705,33)
DEBI METRORIO IPCA - MTRJ19	10.573.572,20	120.384,15	87.571,45	0,10%	423.157,21	(147.895,28)	(807.358,13)
DEBI MG050 IPCA - CRMG15	4.075.450,52	45.627,26	33.051,32	0,04%	159.758,45	(54.931,66)	(309.975,66)
DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16	5.371.131,39	63.263,66	46.098,06	0,06%	233.536,14	(77.736,45)	(466.998,13)
DEBI NORTE EN IPCA - NTEN11	6.064.724,56	64.899,34	46.771,70	0,06%	239.679,38	(84.610,19)	(462.677,67)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS11	3.356.747,59	31.298,43	19.409,30	0,02%	98.419,50	(34.643,72)	(197.622,37)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS21	3.360.193,32	52.472,53	41.999,07	0,05%	213.533,30	(73.077,78)	(373.544,00)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS22	2.370.972,08	34.576,45	28.107,58	0,03%	130.254,72	(43.349,57)	(242.389,59)
DEBI PARANAGU IPCA - PASN12	9.104.149,77	80.676,65	52.246,07	0,06%	261.720,54	(91.087,69)	(516.837,56)
DEBI QUATA IPCA - QUAT12	4.800.862,50	41.436,35	21.058,28	0,03%	133.975,16	(48.099,72)	(272.345,87)
DEBI RT BANDE IPCA - CBAN32	1.374.249,85	17.996,85	14.033,95	0,02%	70.605,97	(23.042,75)	(132.201,55)
DEBI RT BANDE IPCA - CBAN72	4.949.199,36	64.813,53	50.541,63	0,06%	254.279,10	(82.985,77)	(476.108,36)
DEBI TAUBATE IPCA - LTTE15	9.979.796,08	121.509,40	93.240,45	0,11%	428.189,10	(138.251,78)	(798.096,20)
DEBI TESC IPCA - CJEN13	10.760.377,11	147.901,42	117.962,52	0,14%	604.923,38	(211.995,95)	(1.078.056,67)
DEBI TUCANOHO IPCA - TNHL11	6.120.586,52	89.449,66	65.520,70	0,08%	376.799,24	(125.136,89)	(666.094,98)
DEBI UHESIMAO IPCA - UHSM12	5.377.705,52	73.884,72	44.558,12	0,05%	299.844,84	(87.847,48)	(565.602,37)
DEBI UTE GNA IPCA - UNEG11	4.421.925,16	70.006,95	51.196,60	0,06%	279.140,64	(89.980,48)	(490.059,69)
DEBI VENSJOR IPCA - VSJH11	1.265.326,80	10.674,66	6.729,15	0,01%	35.720,60	(12.961,42)	(69.777,34)
DEBI VIA BRAS IPCA - VIMT13	6.061.667,47	81.349,76	62.780,00	0,08%	324.993,02	(108.534,07)	(594.364,04)
DEBI VIARONDO IPCA - VRDN12	7.028.764,88	93.313,40	72.275,60	0,09%	367.249,55	(121.555,13)	(687.019,31)
ECCR32	3.527.049,03	47.731,61	25.649,33	0,03%	20.311,07	(7.326,99)	(43.707,19)
LF ipca	3.484.044,81	67.844,15	53.177,51	0,06%	313.690,38	(107.805,75)	(603.312,64)
LFS ITAU IPCA - LFS0120016V	5.543.920,13	43.513,54	28.897,01	0,03%	15.322,76	(5.538,74)	(33.129,22)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GU	865.423,30	11.189,77	5.208,41	0,01%	5.547,57	(2.002,08)	(11.949,26)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GZ	4.327.116,51	55.948,85	26.042,06	0,03%	27.737,86	(10.010,40)	(59.746,30)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.932.009.925,11	VAR / PL:	2,128%
VAR:	83.692.344,18	ETL / PL:	2,6692%
ETL:	104.953.612,04	VAR / CDI:	4340,53%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(141.185.843,00)	BAIXA 1:	277.759.290,03	Cenário 1:	289.809.456,10
				Cenário 2:	(75.787.377,07)
				Cenário 3:	(483.976.808,62)

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
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H2	10.385.079,62	134.277,25	62.500,95	0,07%	66.570,87	(24.024,96)	(143.391,12)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H4	7.788.809,71	100.707,93	46.875,72	0,06%	49.928,15	(18.018,72)	(107.543,34)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H6	6.057.963,11	78.328,39	36.458,89	0,04%	38.833,01	(14.014,56)	(83.644,82)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001IP	8.679.784,60	115.295,29	54.586,81	0,07%	57.483,12	(20.747,16)	(123.841,87)
LFSN BRADESCO IPCA - LFSN16000GM	12.829.059,02	112.994,32	41.652,62	0,05%	320.215,85	(114.792,22)	(678.894,73)
LFSN BRADESCO IPCA M D - LFSN1800DC5	4.144.254,87	37.545,46	15.672,07	0,02%	121.225,95	(43.340,38)	(255.399,31)
NTNB	1.784.081.237,89	35.208.130,16	33.160.755,75	39,62%	204.637.731,18	(65.258.079,42)	(335.204.506,24)
IDINQFH	(1.294.678,78)	1.413.153,03	(772.243,84)	-0,92%	(15.302.755,18)	15.493,59	1.294.678,78
IDINQFJ	1.821.561,70	1.620.430,06	885.515,47	1,06%	15.422.304,57	(17.799,13)	(1.821.561,70)
IDIVQFT	(298.279,77)	29.953,37	(22.352,86)	-0,03%	(1.326.913,59)	135.997,52	297.651,52
IDIVQHD	158.945,39	15.602,57	11.643,90	0,01%	673.462,05	(71.331,36)	(158.596,01)
IDIVQHV	139.734,17	14.352,45	10.710,23	0,01%	653.105,07	(64.711,13)	(139.451,00)
AB AMERICAN GROWTH	5.635.839,13	638.199,14	(375.273,97)	-0,45%	(310.925,17)	(50.722,55)	451.815,45
BB TOP RF IND PREÇO	170.587.345,63	3.345.391,33	2.798.241,89	3,34%	-	-	-
BR ELETRO FIDC S1	4.112.872,74	4.448,26	2.813,07	0,00%	74.689,79	-	(99.365,30)
FARM SYN AGRO FIDC	3.442.074,55	3.168,06	(1.718,46)	0,00%	(28.767,81)	-	39.481,55
FIDC CELG DIST SN B	2.369.275,46	81.120,59	28.546,17	0,03%	131.093,03	497,50	(167.195,92)
FIDC CREDZ SN3	211.780,16	39.043,35	(19.872,20)	-0,02%	-	-	-
FIDC VERDECARD SN4	5.883.587,21	1.753,01	1.106,44	0,00%	54.925,70	-	(73.825,16)
FII HSI LOGISTICA	2.449.931,40	73.541,16	9.812,84	0,01%	10.928,83	-	(14.773,42)
FII VIA PQ SHOPPING	1.259.250,00	38.266,29	(5.673,03)	-0,01%	(10.490,09)	(41,07)	14.396,35
FUNDSMITH EQ FUND	6.711.572,31	707.128,98	(477.263,20)	-0,57%	(367.633,70)	(60.404,15)	533.957,47
LOOMIS US GROWTH	5.998.045,90	649.884,46	(603.345,36)	-0,72%	(553.814,82)	(53.982,41)	843.953,91
MFS MERIDIAN EUROPEA	4.232.794,11	226.707,05	(132.638,18)	-0,16%	(31.464,88)	(38.095,15)	43.135,61
RB CAP CREDIT AL SN4	833.296,74	6.495,64	3.844,58	0,00%	(1.759,58)	-	2.397,07
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	798.705,56	23.453,97	3.330,36	0,00%	85.466,05	-	(103.054,40)
WELLINGTON GLO QUAL	8.691.856,77	941.757,16	(874.316,67)	-1,04%	(802.541,23)	(78.226,71)	1.222.986,06
Total	3.895.157.462,39	132.565.867,00	83.692.344,18	100,00%	289.809.456,10	(75.787.377,07)	(483.976.808,62)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

EMBRAERPREV RENDA FIXA CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	2.407.840.696,84	VAR / PL:	1,745%
VAR:	42.020.007,16	ETL / PL:	2,1885%
ETL:	52.694.802,29	VAR / CDI:	3558,77%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(123.898.663,48)	BAIXA 1:	255.692.248,13	Cenário 1:	185.128.320,01
				Cenário 2:	(65.157.432,86)
				Cenário 3:	(309.988.685,89)

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	5.999,44	5,46	3,78	0,00%	(50,47)	(0,20)	69,28
CONTAS A PAGAR / RECEBER	14.939.107,20	13.590,96	9.400,78	0,02%	(125.686,93)	(492,07)	172.506,76
COMPROMISSADA	263.014.483,84	237.921,48	165.258,91	0,39%	(2.192.743,39)	(19.042,23)	3.006.424,81
CRI RB CAPIT IPCA M D - 17H0164854	7.009.976,39	67.710,47	53.155,24	0,13%	104.550,11	(58.243,03)	(251.470,95)
DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23	12.823.079,36	104.149,82	68.475,08	0,16%	140.056,07	(89.453,01)	(368.400,91)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.570.705,72	50.455,73	30.178,91	0,07%	41.761,86	(28.942,25)	(116.704,45)
DE252 CEMIG - IPCA CMTD33	1.961.884,69	22.072,25	14.320,09	0,03%	15.663,48	(11.633,31)	(46.056,07)
DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17	35.801.289,01	428.850,54	319.792,15	0,76%	1.074.025,20	(6.424,38)	(2.316.603,36)
DE252 CSMG IPCA - CSMGC3	12.838.088,48	129.546,75	82.275,62	0,20%	94.768,83	(73.303,99)	(277.740,03)
DE252 DUKE GEP - IPCA GEP24	15.256.486,25	104.279,75	51.901,73	0,12%	(43.160,38)	(31.309,87)	(8.152,74)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	9.376.402,48	90.162,35	60.296,01	0,14%	129.796,83	(75.456,53)	(326.628,30)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36	3.047.137,15	33.637,15	20.119,27	0,05%	27.841,24	(19.294,83)	(77.802,96)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	1.043.162,58	16.439,87	9.558,23	0,02%	(197,17)	(3.132,87)	(6.464,78)
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	662.626,27	2.524,71	41,30	0,00%	(5.272,24)	(132,02)	6.986,09
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	1.081.815,64	15.070,02	9.356,95	0,02%	(3.176,91)	(2.174,70)	(281,83)
DE252 PETR IPCA - PETR45	15.019.561,11	166.394,68	99.205,17	0,24%	85.559,25	(76.558,44)	(278.660,44)
DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34	3.069.206,78	46.502,95	26.486,77	0,06%	3.911,67	(10.848,28)	(28.826,41)
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	5.223.345,23	82.318,04	47.860,19	0,11%	(987,26)	(15.686,99)	(32.370,56)
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	12.964.104,59	132.559,51	85.579,52	0,20%	139.939,56	(89.798,02)	(375.883,21)
DE252 TRANS AL - IPCA TAE33	12.070.631,50	138.142,97	88.379,91	0,21%	59.588,51	(58.407,85)	(205.644,51)
DEBI ELETROB IPCA - ELET42	10.801.707,48	130.513,29	119.576,84	0,28%	362.424,39	(154.602,42)	(768.572,55)
DEBI ENERGMIR IPCA - ENMI21	897.540,19	8.688,41	6.751,82	0,02%	16.098,81	(8.444,70)	(37.799,64)
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	24.161.655,92	309.980,73	292.673,73	0,70%	874.193,92	(381.755,49)	(1.761.315,32)
DEBI IGUA SAN IPCA - IGSN15	2.208.408,29	27.836,92	25.723,14	0,06%	83.367,94	(34.499,63)	(164.705,15)
DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21	1.455.504,44	14.176,35	10.883,23	0,03%	24.869,04	(13.262,27)	(58.925,94)
DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16	5.377.063,77	67.308,02	61.298,58	0,15%	188.006,35	(77.933,04)	(404.600,14)
ECCR32	3.533.489,10	49.222,57	30.562,21	0,07%	(10.376,61)	(7.103,13)	(920,53)
LFS ITAU IPCA - LFS0120016V	5.547.163,64	47.615,29	35.637,60	0,08%	(31.785,50)	(5.565,49)	31.839,20
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GU	866.709,16	11.545,92	6.805,53	0,02%	(1.959,47)	(1.954,27)	(1.495,41)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GZ	4.333.545,81	57.729,60	34.027,66	0,08%	(9.797,35)	(9.771,34)	(7.477,03)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H2	10.400.509,93	138.551,05	81.666,39	0,19%	(23.513,64)	(23.451,22)	(17.944,88)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H4	7.800.382,45	103.913,29	61.249,80	0,15%	(17.635,23)	(17.588,42)	(13.458,66)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H6	6.066.964,13	80.821,45	47.638,73	0,11%	(13.716,29)	(13.679,88)	(10.467,85)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001IP	8.691.023,93	118.599,09	70.009,71	0,17%	(17.605,10)	(20.334,99)	(19.407,59)
LFSN BRADESCO IPCA - LFSN16000GM	12.834.732,35	117.322,91	77.471,64	0,18%	211.235,28	(114.866,70)	(528.703,06)
LFSN BRADESCO IPCA M D - LFSN1800DC5	4.146.638,08	38.548,09	26.396,27	0,06%	85.954,57	(43.343,71)	(206.764,25)
NTNB	1.666.986.138,62	36.475.324,49	36.379.511,65	86,58%	185.297.410,08	(63.553.322,98)	(306.455.870,11)
BB TOP RF IND PREÇO	170.568.264,66	3.642.954,76	3.410.477,00	8,12%	(1.435.039,02)	(5.618,30)	1.969.607,58
Total	2.378.456.535,65	43.322.987,70	42.020.007,16	100,00%	185.128.320,01	(65.157.432,86)	(309.988.685,89)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	474.677.672,26	VAR / PL:	10,780%
VAR:	51.171.233,89	ETL / PL:	13,5188%
ETL:	64.170.813,73	VAR / CDI:	21983,60%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(569,29)	BAIXA 1:	589,96	Cenário 1:	58.965.294,49
				Cenário 2:	190.978,75
				Cenário 3:	(66.156.470,45)

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	21.298,69	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	8.708.552,50	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	8.615.503,55	698.779,85	418.901,99	0,82%	639.055,41	2.403,72	(798.275,18)
ALPA4	203.247,68	28.777,90	16.319,93	0,03%	21.935,05	81,23	(26.423,47)
ALSO3	2.393.495,00	300.772,88	252.879,68	0,49%	404.966,84	1.459,09	(458.048,65)
AMER3	1.726.372,83	676.094,27	486.066,46	0,95%	1.118.416,18	-	(850.646,52)
ASAI3	598.269,82	94.037,01	75.116,34	0,15%	48.648,93	-	(60.298,79)
AURE3	9.003.133,26	1.574.532,63	(507.788,60)	-0,99%	-	-	-
AZUL4	213.505,50	85.315,40	68.814,59	0,13%	135.534,37	409,53	(104.026,61)
B3SA3	10.655.345,27	1.581.512,30	930.402,14	1,82%	900.069,67	3.369,24	(1.111.798,63)
Banco BTG Pactual SA UNT	14.257.384,16	1.928.222,08	1.701.590,79	3,33%	2.101.002,66	7.643,03	(2.429.345,34)
BBAS3	10.757.406,27	1.601.970,27	1.440.849,64	2,82%	1.441.379,84	5.274,84	(1.689.659,20)
BBDC3	1.153.261,75	159.789,97	150.636,80	0,29%	148.462,91	544,60	(174.985,06)
BBDC4	18.194.040,13	2.760.396,22	2.583.150,90	5,05%	2.611.573,72	9.516,55	(3.031.519,53)
BBSE3	3.496.344,82	316.241,94	222.877,90	0,44%	146.325,76	558,90	(189.466,68)
BEEF3	1.346.546,73	162.175,15	97.571,83	0,19%	(8.299,58)	(32,46)	11.360,85
BMGB4	159.900,00	15.680,28	10.749,77	0,02%	16.631,72	61,70	(20.118,16)
BPAN4	109.833,37	22.010,90	14.960,99	0,03%	33.451,97	113,91	(33.304,43)
BRAP4	334.581,48	48.770,72	38.785,96	0,08%	40.127,20	147,78	(47.731,29)
BRFS3	773.298,27	173.017,62	94.491,94	0,18%	97.955,32	359,66	(115.701,88)
BRKM5	522.849,66	90.780,27	73.486,94	0,14%	107.867,25	382,47	(117.635,95)
BRML3	8.566.618,60	921.880,61	494.009,77	0,97%	1.143.250,36	4.184,82	(1.340.917,69)
CASH3	31.189,32	13.925,73	12.295,18	0,02%	23.236,25	-	(16.553,13)
CCRO3	738.468,16	79.560,45	68.734,13	0,13%	53.543,96	201,56	(67.006,57)
CIEL3	1.217.576,28	225.978,25	180.624,03	0,35%	18.624,59	72,06	(24.860,01)
CLSA3	103.522,00	24.939,17	(502,59)	0,00%	16.433,21	-	(18.783,35)
CMIG4	794.807,07	126.345,86	116.337,40	0,23%	93.220,13	343,73	(111.193,03)
CMIN3	228.751,35	46.213,56	23.369,05	0,05%	26.630,99	-	(31.794,38)
COGN3	206.687,64	55.672,10	50.215,07	0,10%	54.349,24	188,20	(56.186,66)
CPFE3	4.727.820,68	967.092,66	644.435,21	1,26%	719.673,47	2.612,40	(828.040,78)
CPL6	564.069,27	64.565,88	57.421,09	0,11%	59.484,75	220,52	(71.844,18)
CRFB3	363.206,00	77.889,62	57.750,03	0,11%	71.595,62	254,86	(78.778,76)
CSAN3	1.126.343,53	203.817,73	171.063,31	0,33%	165.611,37	602,55	(191.556,99)
CSED3	958.263,00	177.453,17	120.092,52	0,23%	175.141,48	-	(195.445,39)
CSNA3	525.114,46	145.258,44	129.966,78	0,25%	171.211,06	578,05	(167.257,40)
CVCB3	82.685,09	31.645,21	21.880,97	0,04%	35.336,60	114,78	(31.701,52)
CYRE3	660.986,24	126.526,58	90.921,26	0,18%	138.070,78	489,03	(150.200,16)
DXCO3	154.485,26	15.755,29	5.816,31	0,01%	17.825,34	-	(21.304,55)
ECOR3	102.092,71	26.031,55	22.875,11	0,04%	21.585,72	76,37	(23.424,46)
EGIE3	556.971,86	54.813,30	46.420,15	0,09%	39.018,59	147,05	(48.960,52)
ELET3	13.914.747,27	1.354.744,49	727.205,89	1,42%	19.380,26	75,50	(26.292,62)
ELET6	7.184.981,87	648.365,01	217.393,67	0,42%	(137.552,68)	(541,45)	191.233,23



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	474.677.672,26	VAR / PL:	10,780%
VAR:	51.171.233,89	ETL / PL:	13,5188%
ETL:	64.170.813,73	VAR / CDI:	21983,60%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(569,29)	BAIXA 1:	589,96	Cenário 1:	58.965.294,49
				Cenário 2:	190.978,75
				Cenário 3:	(66.156.470,45)

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
ENBR3	250.160,50	26.187,74	19.923,74	0,04%	17.751,17	66,87	(22.252,07)
ENEV3	7.959.036,16	976.237,51	835.017,55	1,63%	407.102,39	1.548,04	(521.646,93)
ENGI11	529.916,61	59.013,14	31.239,49	0,06%	31.840,42	120,56	(40.395,19)
ENJU3	138.822,00	68.964,19	57.071,90	0,11%	124.651,96	-	(80.704,80)
EQTL3	18.764.841,67	1.181.471,94	557.090,57	1,09%	519.599,71	1.998,31	(683.717,45)
ESPA3	64.988,00	22.530,39	10.303,19	0,02%	19.330,33	-	(19.367,83)
EUCATEX PN	124.972,00	36.247,92	30.865,58	0,06%	38.551,23	131,07	(38.248,16)
EZTC3	1.057.870,06	165.211,33	138.649,84	0,27%	178.597,13	643,59	(202.081,34)
FLRY3	261.761,73	29.461,45	11.822,74	0,02%	18.196,29	68,59	(22.846,25)
GGBR4	7.857.835,50	1.996.036,78	1.874.284,74	3,66%	2.347.903,88	8.013,27	(2.349.613,24)
GGPS3	2.821.829,60	564.946,71	457.086,50	0,89%	746.256,06	-	(770.417,62)
GMAT3	4.647.702,80	1.192.107,31	1.031.386,98	2,02%	1.869.411,53	6.129,59	(1.711.886,35)
GOAU4	352.433,24	90.364,77	84.306,84	0,16%	102.136,44	349,85	(103.038,98)
GOLL4	80.931,62	32.787,14	28.215,81	0,06%	50.593,89	153,36	(39.096,82)
HAPV3	8.917.730,21	1.527.375,13	195.891,83	0,38%	1.488.715,48	5.369,11	(1.687.656,09)
HYPE3	5.289.614,25	660.032,56	601.867,88	1,18%	326.148,54	1.234,02	(413.056,75)
IGTH1	1.446.827,78	231.514,26	155.090,15	0,30%	-	-	-
INTB3	1.771.707,00	124.096,32	51.507,55	0,10%	120.670,94	-	(151.741,81)
IRBR3	134.684,43	35.423,43	26.398,64	0,05%	25.003,77	89,45	(27.823,38)
ITSA4	12.194.439,66	1.335.964,19	1.250.079,01	2,44%	1.425.190,83	5.256,04	(1.700.707,44)
ITUB4	24.883.023,38	3.309.267,04	3.199.069,89	6,25%	3.317.949,04	12.145,81	(3.892.071,62)
JBSS3	8.986.154,83	775.395,12	561.738,79	1,10%	801.918,18	2.995,18	(985.471,51)
JHSF3	92.906,89	21.733,70	16.762,03	0,03%	16.550,91	59,40	(18.554,33)
KLBN11	866.822,50	95.126,98	78.377,68	0,15%	105.378,74	387,81	(125.133,76)
LCAM3	1.939.857,40	223.525,93	192.555,99	0,38%	220.563,38	814,60	(264.080,93)
LREN3	10.046.492,17	1.768.466,62	1.625.387,69	3,18%	1.769.993,06	6.357,85	(1.988.115,01)
LWSA3	2.131.059,06	612.232,66	325.424,04	0,64%	492.292,18	1.727,44	(524.339,90)
MATD3	1.293.170,55	223.895,27	115.018,61	0,22%	252.245,82	-	(278.112,16)
MDNE3	84.810,00	20.291,58	17.745,14	0,03%	21.594,19	75,03	(22.496,86)
MGLU3	358.237,66	119.024,32	91.571,31	0,18%	203.781,38	629,52	(163.971,09)
MOV13	779.085,00	222.054,41	191.911,07	0,38%	246.445,85	835,26	(242.817,61)
MRFG3	222.157,97	33.740,77	18.965,78	0,04%	42.401,16	151,34	(46.941,60)
MRVE3	311.798,64	53.133,33	44.091,23	0,09%	76.507,98	266,86	(80.394,91)
MULT3	4.497.423,34	628.038,12	379.945,45	0,74%	399.538,11	1.492,56	(491.202,34)
NEXP3	14.784,00	-	-	0,00%	-	-	-
NINJ3	240.381,00	86.202,95	71.926,19	0,14%	113.498,61	-	(98.257,55)
NTCO3	5.743.035,39	1.309.015,55	907.364,84	1,77%	1.322.415,05	4.641,75	(1.409.495,32)
ONCO3	637.488,00	143.963,95	63.094,34	0,12%	179.174,31	-	(182.191,21)
PACUCAR_CBD ON ED	136.553,40	26.382,06	22.056,58	0,04%	32.095,52	112,43	(34.054,96)
PARD3	593.403,15	101.998,95	88.217,48	0,17%	94.305,18	341,31	(107.772,22)
PETR3	11.867.142,07	2.439.556,20	1.986.298,25	3,88%	1.766.172,92	6.420,81	(2.039.139,92)
PETR4	29.663.895,16	6.208.567,74	4.935.544,85	9,65%	4.266.944,85	15.546,61	(4.951.542,44)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	474.677.672,26	VAR / PL:	10,780%
VAR:	51.171.233,89	ETL / PL:	13,5188%
ETL:	64.170.813,73	VAR / CDI:	21983,60%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(569,29)	BAIXA 1:	589,96	Cenário 1:	58.965.294,49
				Cenário 2:	190.978,75
				Cenário 3:	(66.156.470,45)

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
PETZ3	2.167.470,77	350.164,23	81.112,95	0,16%	337.415,71	1.222,94	(386.867,73)
POS13	22.943,70	6.412,58	5.822,08	0,01%	8.457,44	28,09	(7.965,14)
PRI03	10.877.397,59	2.662.054,35	2.119.159,04	4,14%	2.966.601,38	10.231,94	(3.039.517,55)
QUAL3	163.380,97	39.778,49	(20.336,11)	-0,04%	(23.291,13)	(97,94)	37.977,03
RADL3	4.477.248,12	722.152,41	162.874,30	0,32%	114.199,58	439,66	(150.646,82)
RAIL3	9.847.341,67	1.618.535,65	954.383,92	1,87%	334.562,35	1.282,76	(437.086,63)
RDOR3	4.006.456,15	707.414,14	468.064,20	0,91%	759.849,30	-	(842.210,21)
RECV3	3.771.182,48	940.172,21	768.011,97	1,50%	751.160,27	-	(824.864,97)
RENT3	9.954.912,82	1.322.317,26	1.154.558,53	2,26%	1.398.717,63	5.103,81	(1.628.690,34)
RRRP3	371.746,44	130.973,06	115.025,58	0,22%	135.899,36	451,84	(128.319,41)
SANB11	551.164,17	85.445,30	71.823,04	0,14%	76.732,12	280,15	(89.466,30)
SBSP3	755.011,76	143.951,87	114.970,98	0,22%	109.959,93	400,32	(127.368,00)
SEER3	499.266,28	68.214,31	51.723,72	0,10%	100.512,03	357,15	(110.145,56)
SLCE3	221.841,53	48.309,10	32.757,80	0,06%	37.871,21	136,36	(42.770,36)
SOMA3	2.531.481,23	443.473,52	340.272,33	0,66%	438.107,68	1.575,83	(493.624,56)
STBP3	3.589.260,00	729.420,75	624.854,98	1,22%	740.130,79	2.624,43	(807.236,28)
SULA11	944.664,54	172.100,04	135.593,19	0,26%	162.468,40	584,66	(183.253,16)
SUZB3	12.139.913,19	1.293.485,54	952.319,57	1,86%	1.274.483,70	4.725,80	(1.540.062,60)
TAAE11	445.752,09	39.435,22	18.221,68	0,04%	12.559,34	48,29	(16.517,07)
TEND3	464.490,00	81.716,44	1.541,50	0,00%	103.534,34	364,54	(111.126,73)
TIMS3	3.521.441,06	439.520,61	379.621,79	0,74%	460.989,28	1.689,36	(542.118,72)
TOTS3	3.372.537,25	653.451,59	422.186,02	0,83%	553.708,36	1.999,38	(629.439,48)
UGPA3	4.940.261,59	888.248,25	812.515,20	1,59%	829.746,52	2.991,18	(939.670,37)
USIM5	235.617,38	41.038,29	37.918,20	0,07%	68.571,56	234,76	(69.101,23)
VALE3	49.536.006,05	7.878.291,00	6.423.748,46	12,55%	6.604.759,80	24.177,74	(7.747.691,94)
VBBR3	6.737.321,72	789.544,78	690.164,67	1,35%	1.229.164,98	-	(1.372.105,41)
VIIA3	161.921,30	58.849,81	56.263,15	0,11%	85.169,37	-	(70.746,49)
VIVT3	1.032.731,82	117.336,69	85.736,30	0,17%	104.380,77	387,74	(126.657,21)
WEGE3	6.348.158,94	895.246,38	(155.710,14)	-0,30%	6.863,83	26,75	(9.315,37)
YDUQ3	1.906.089,61	456.160,83	389.473,93	0,76%	650.715,60	2.183,82	(627.268,26)
INDQ22	-	88.559,63	67.181,79	0,13%	-	-	-
COMPROMISSADA	12.679.740,43	192,13	8,56	0,00%	967,65	(500,36)	(1.479,52)
EMP AÇÃO PROVISÃO	22.994,92	13,85	9,14	0,00%	130,67	(59,35)	(164,86)
LFT	319.649,31	31,15	3,49	0,00%	0,00	0,00	(0,00)
Total	474.728.741,65	70.396.951,26	51.171.233,89	100,00%	58.965.294,49	190.978,75	(66.156.470,45)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FI RF EMB II CNPJ - 11005764000196

Dados Gerais

PL:	2.228.582.369,18	VAR / PL:	1,563%
VAR:	34.842.514,20	ETL / PL:	1,9606%
ETL:	43.693.933,47	VAR / CDI:	3188,25%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(122.948.003,09)	BAIXA 1:	251.231.579,65	Cenário 1:	188.351.675,33
				Cenário 2:	(64.292.258,94)
				Cenário 3:	(312.713.947,99)

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	53,95	7,06	0,00%	(31,62)	(0,12)	43,29
CONTAS A PAGAR / RECEBER	14.958.111,20	161.402,11	21.119,89	0,06%	(94.602,99)	(369,99)	129.521,69
COMPROMISSADA	258.720.174,16	2.792.930,15	365.999,79	1,05%	(1.616.538,79)	(16.608,90)	2.210.059,26
DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17	29.666.674,67	460.889,59	317.041,67	0,91%	951.955,50	(5.080,18)	(2.005.337,52)
DE252 CSMG IPCA - CSMGC3	12.839.524,64	102.107,85	39.851,91	0,11%	121.598,05	(73.206,86)	(314.856,36)
DE252 PETR IPCA - PETR45	15.021.241,31	123.908,78	42.005,15	0,12%	116.944,52	(76.443,78)	(322.078,47)
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	5.105.190,90	37.127,85	6.415,54	0,02%	9.698,56	(15.290,26)	(46.383,99)
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	7.339.908,78	65.175,61	27.487,34	0,08%	94.561,09	(50.780,88)	(234.014,77)
DEBI ELETROB IPCA - ELET42	10.802.915,83	130.590,48	107.552,34	0,31%	385.029,58	(154.531,09)	(799.861,32)
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	10.439.383,74	125.803,05	110.272,61	0,32%	399.513,11	(164.857,20)	(791.153,86)
DEBI IGUA SAN IPCA - IGSN15	2.208.655,34	26.788,13	22.666,16	0,07%	87.990,60	(34.485,38)	(171.102,98)
DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16	5.377.665,28	67.373,34	55.655,94	0,16%	199.260,01	(77.897,64)	(420.178,08)
LFS ITAU IPCA - LFS0120016V	5.547.784,19	47.172,71	24.551,37	0,07%	(20.201,10)	(5.520,60)	15.818,73
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GU	866.806,12	4.872,43	1.161,60	0,00%	(149,14)	(1.947,38)	(3.999,23)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GZ	4.334.030,59	24.362,13	5.808,02	0,02%	(745,72)	(9.736,88)	(19.996,14)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H2	10.401.673,41	58.469,12	13.939,25	0,04%	(1.789,72)	(23.368,51)	(47.990,74)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H4	7.801.255,06	43.851,84	10.454,44	0,03%	(1.342,29)	(17.526,39)	(35.993,05)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H6	6.067.642,82	34.106,99	8.131,23	0,02%	(1.044,00)	(13.631,63)	(27.994,60)
NTNB	1.667.172.619,44	31.685.688,89	31.586.826,89	90,66%	188.800.454,05	(63.546.755,76)	(311.305.558,91)
BB TOP RF IND PREÇO	170.587.345,63	2.410.586,51	2.075.566,00	5,96%	(1.078.884,37)	(4.219,50)	1.477.109,05
Total	2.245.263.603,09	38.403.261,49	34.842.514,20	100,00%	188.351.675,33	(64.292.258,94)	(312.713.947,99)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FI RF EMB V CREDITO PRIVADO CNPJ - 20726178000121

Dados Gerais

PL:	179.258.327,66	VAR / PL:	0,609%
VAR:	1.091.627,84	ETL / PL:	0,7637%
ETL:	1.368.945,82	VAR / CDI:	1241,84%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(3.411.915,49)	BAIXA 1:	2.270.502,90	Cenário 1:	2.609.696,60
				Cenário 2:	(849.552,75)
				Cenário 3:	(5.335.058,83)

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	(17.330,87)	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	4.323.248,71	65,51	(18,03)	0,00%	329,93	(170,60)	(504,45)
CRI RB CAPIT IPCA M D - 17H0164854	7.009.976,39	62.546,79	62.287,49	5,71%	163.527,02	(58.012,13)	(332.417,44)
DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23	12.823.079,36	96.262,90	91.113,08	8,35%	247.940,26	(89.030,63)	(516.473,21)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.570.705,72	47.050,20	45.093,73	4,13%	80.216,50	(28.791,70)	(169.483,88)
DE252 CEMIG - IPCA CMDT33	1.961.884,69	20.511,96	19.801,33	1,81%	32.169,37	(11.568,69)	(68.710,60)
DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17	6.137.932,69	72.141,37	31.294,57	2,87%	235.775,83	(899,25)	(468.045,53)
DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24	15.256.486,25	93.729,93	82.465,66	7,55%	85.196,75	(30.807,34)	(184.324,38)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	9.376.402,48	83.889,76	81.544,22	7,47%	208.683,16	(75.147,68)	(434.900,69)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36	3.047.137,15	31.366,80	30.062,49	2,75%	53.477,67	(19.194,46)	(112.989,25)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	1.043.162,58	15.572,59	12.567,47	1,15%	8.579,25	(3.098,51)	(18.510,52)
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	662.626,27	2.691,46	(349,40)	-0,03%	302,63	(110,19)	(665,47)
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	1.081.815,64	14.190,20	10.602,22	0,97%	5.924,71	(2.139,06)	(12.773,91)
DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34	3.069.206,78	43.953,11	37.130,27	3,40%	29.733,77	(10.747,19)	(64.267,54)
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	118.725,37	1.772,36	1.430,34	0,13%	976,43	(352,65)	(2.106,74)
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	5.625.016,81	53.449,94	52.303,04	4,79%	108.043,47	(38.777,33)	(228.046,50)
DE252 TRANS AL - IPCA TAEE33	12.070.631,50	128.253,57	120.024,01	10,99%	161.142,14	(58.010,26)	(345.028,04)
DEBI ENERGMIR IPCA - ENMI21	897.540,19	8.078,14	7.909,74	0,72%	23.650,07	(8.415,14)	(48.163,83)
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	13.723.439,87	167.795,81	141.744,94	12,98%	611.987,55	(216.379,07)	(1.158.868,40)
DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21	1.455.504,44	13.163,84	12.977,01	1,19%	37.114,61	(13.214,33)	(75.733,12)
ECCR32	3.533.489,10	46.348,86	34.629,60	3,17%	19.351,63	(6.986,74)	(41.722,88)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001IP	8.691.023,93	111.374,99	90.728,52	8,31%	55.514,94	(20.048,72)	(119.765,68)
LFSN BRADESCO IPCA - LFSN16000GM	12.834.732,35	111.396,96	95.832,53	8,78%	319.217,51	(114.443,94)	(676.909,92)
LFSN BRADESCO IPCA M D - LFSN1800DC5	4.146.638,08	36.775,87	30.453,00	2,79%	120.841,41	(43.207,12)	(254.646,84)
Total	133.444.075,47	1.262.382,94	1.091.627,84	100,00%	2.609.696,60	(849.552,75)	(5.335.058,83)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIM EMB I A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	237.945.570,99	VAR / PL:	0,209%
VAR:	496.504,52	ETL / PL:	0,2617%
ETL:	622.636,91	VAR / CDI:	425,52%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(4.086.467,27)	BAIXA 1:	3.755.238,91	Cenário 1:	3.587.169,70
				Cenário 2:	(2.670.678,25)
				Cenário 3:	(6.385.431,33)

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	8,19	3,80	0,00%	(75,72)	(0,30)	103,93
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(13.098,78)	11,92	(5,53)	0,00%	110,20	0,43	(151,26)
DI1Q22	-	276.510,04	80.717,10	16,26%	(1.789.983,64)	924.433,50	2.731.224,16
DI1V22	-	640.304,08	(44.733,73)	-9,01%	6.437.008,84	(3.314.588,43)	(9.773.720,66)
DI1F24	-	38.239,09	(33.992,58)	-6,85%	(199.024,33)	100.637,84	293.202,57
DI1F25	-	8.786,86	7.271,25	1,46%	38.995,86	(19.470,07)	(56.253,55)
DI1F27	-	70.244,45	59.253,13	11,93%	280.562,42	(136.206,00)	(386.426,82)
DI1F29	-	17.117,49	(14.542,08)	-2,93%	(65.185,59)	30.736,89	85.594,68
DOLQ22	-	147.812,84	126.243,23	25,43%	123.917,98	10.746,23	(189.643,09)
WDOQ22	-	17.737,54	15.149,19	3,05%	14.870,16	1.289,55	(22.757,17)
COMPROMISSADA	183.322.052,43	165.832,14	77.746,64	15,66%	(1.528.350,12)	(13.272,50)	2.095.489,04
DE252 AERIS CDI - AERH11	169.100,09	159,00	98,74	0,02%	(1.223,95)	(105,73)	1.661,46
DE252 AUTOBAN CDI - ANHB10	836.317,85	745,77	403,00	0,08%	(6.605,40)	(243,96)	9.029,33
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.750.196,29	1.518,33	739,19	0,15%	(14.376,46)	(234,90)	19.691,60
DE252 BCBF CDI - BCBF14	272.924,37	248,37	144,82	0,03%	(2.054,88)	(130,90)	2.796,56
DE252 CONT GLO CDI - CGBP13	2.345.086,23	2.869,02	2.157,46	0,43%	(13.395,35)	(3.194,15)	18.155,90
DE252 ELETROB CDI - ELET13	2.098.436,48	2.076,46	1.386,80	0,28%	(14.470,19)	(1.664,22)	19.612,54
DE252 ENERG TR CDI - ETEN13	2.969.477,52	24.330,23	21.565,98	4,34%	75.482,22	(48.379,42)	(101.936,56)
DE252 EQUATENE CDI - EQTL13	1.477.062,40	1.299,86	673,99	0,14%	(11.816,15)	(358,48)	16.151,51
DE252 GUARIROB CDI - GRRB14	1.109.588,44	1.000,53	556,44	0,11%	(8.666,22)	(371,96)	11.841,00
DE252 INTERVIA CDI - IVIA35	1.316.135,66	1.165,94	620,46	0,12%	(10.422,81)	(372,30)	14.239,11
DE252 MOV_PART CDI - MOVI33	1.532.490,47	1.318,89	609,30	0,12%	(12.893,26)	(50,48)	17.696,15
DE252 OMEGA GE CDI - OMGE13	1.081.139,27	1.354,17	1.028,73	0,21%	(6.014,13)	(1.551,81)	8.144,00
DE252 PROLAGOS CDI - PRLG14	2.937.738,19	9.410,28	(7.663,36)	-1,54%	(76.756,41)	26.268,87	110.837,51
DE252 RT BANDE CDI - CBAN22	1.101.455,44	1.109,71	746,41	0,15%	(7.525,26)	(905,88)	10.205,88
DE252 SUL AME CDI - SULM15	665.762,54	594,77	258,91	0,05%	(5.948,50)	157,62	8.218,68
DE252 VAMOS CDI - VAMO22	1.122.294,11	1.070,34	675,81	0,14%	(8.073,98)	(723,78)	10.967,85
LF selic	3.207.455,62	2.760,40	1.275,24	0,26%	(26.985,21)	(105,65)	37.037,51
LF252 B.ALFA CDI - LF0021006S0	1.077.293,53	927,14	428,32	0,09%	(9.063,57)	(35,48)	12.439,85
LF252 BES INV CDI - LF00220018H	1.082.905,43	931,97	430,55	0,09%	(9.110,78)	(35,67)	12.504,65
LF252 DAYCOVAL CDI - LF002100HDP	1.282.989,00	1.104,17	510,10	0,10%	(10.794,14)	(42,26)	14.815,08
LF252 DAYCOVAL CDI - LF002100HDQ	2.337.271,52	2.011,51	929,27	0,19%	(19.664,11)	(76,99)	26.989,22
LFT	19.529.816,13	13.660,09	8.234,28	1,66%	(164.309,73)	(643,29)	225.517,00
LFV TOYOTA CDI - LF002100ISJ	2.396.175,10	2.062,20	952,69	0,19%	(20.159,68)	(78,93)	27.669,40
NTNB	4.559.134,25	121.449,75	109.959,69	22,15%	662.446,71	(220.567,12)	(1.059.531,36)
IDINQFH	(72.342,65)	1.686.151,78	(790.514,03)	-159,22%	(17.348.266,97)	11.856,45	71.507,29
IDINQFJ	716.617,13	1.849.452,36	867.073,80	174,64%	17.345.004,41	(13.382,57)	(708.342,12)
IDIVQFT	(0,12)	1,34	(1,04)	0,00%	(1.670.124,93)	0,07	0,07
IDIVQHD	18,80	145,15	112,58	0,02%	855.275,69	(12,49)	(12,27)
IDIVQHV	0,00	0,00	0,00	0,00%	814.836,67	(0,00)	(0,00)
Total	242.220.492,73	5.113.534,18	496.504,52	100,00%	3.587.169,70	(2.670.678,25)	(6.385.431,33)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIM EMB II A CNPJ - 20725957000102

Dados Gerais

PL:	228.021.467,58	VAR / PL:	0,528%
VAR:	1.203.894,67	ETL / PL:	0,6621%
ETL:	1.509.733,00	VAR / CDI:	1076,67%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(3.184.446,89)	BAIXA 1:	4.352.105,01	Cenário 1:	3.492.646,55
				Cenário 2:	(1.291.289,81)
				Cenário 3:	(6.533.646,98)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(21.081,63)	-	-	0,00%	-	-	-
INDQ22	-	357.780,85	(148.242,92)	-12,31%	-	-	-
WINQ22	-	1.474.437,94	1.097.697,54	91,18%	-	-	-
D11V22	-	646,32	(159,05)	-0,01%	6.497,49	(3.345,73)	(9.865,55)
D11F23	-	3.016,61	(693,24)	-0,06%	34.504,83	(17.694,86)	(52.035,28)
D11N23	-	9.345,93	1.414,69	0,12%	(69.417,41)	35.332,99	103.389,31
D11F24	-	143.042,52	32.437,65	2,69%	(744.498,40)	376.460,08	1.096.794,78
D11J24	-	3.967,61	(886,16)	-0,07%	19.219,62	(9.689,00)	(28.171,73)
D11N24	-	7.912,56	(1.735,90)	-0,14%	36.322,58	(18.252,70)	(52.960,30)
D11F25	-	44.733,13	(9.900,56)	-0,22%	198.524,40	(99.120,33)	(286.381,69)
D11N25	-	169.796,17	43.540,95	3,62%	(738.459,78)	366.321,69	1.053.915,27
D11F27	-	17.880,40	(4.494,03)	-0,37%	71.415,89	(34.670,62)	(98.363,19)
D11F29	-	65.357,68	(17.480,06)	-1,45%	248.890,44	(117.359,02)	(326.816,05)
D11F31	-	14.448,34	(3.943,94)	-0,33%	55.929,89	(25.605,45)	(69.995,11)
D11F33	-	1.575,16	(426,06)	-0,04%	6.143,69	(2.731,00)	(7.330,82)
WDOQ22	-	313.363,22	217.300,03	18,05%	(262.706,12)	(22.782,02)	402.043,36
COMPROMISSADA	42.882.715,92	649,77	(174,05)	-0,01%	3.272,57	(1.692,20)	(5.003,72)
LTN	19.545.123,78	194.846,12	(48.936,63)	-4,06%	904.979,27	(450.407,95)	(1.298.699,11)
DE252 AEGEA SA CDI - AEGP13	1.091.143,75	56,79	(1,94)	0,00%	48,95	(25,10)	(73,83)
DE252 COPEL GT CDI - CPGT14	303.977,11	112,01	19,56	0,00%	(786,29)	403,81	1.188,64
DE252 COPEL GT CDI - CPGT16	304.067,96	131,03	25,72	0,00%	(668,55)	340,24	995,54
DE252 ECORODOV CDI - ERDV18	1.818.918,05	13.126,00	(3.423,05)	-0,28%	50.218,64	(23.936,05)	(67.115,43)
DE252 ENERSUL CDI - ESUL18	1.062.591,37	29,80	7,17	0,00%	(334,31)	172,87	511,13
LF selic	3.981.283,12	1.114,46	227,36	0,02%	(4.777,78)	2.482,43	7.363,90
LFT	52.721.958,55	41.859,95	(17.201,84)	-1,43%	0,36	0,00	(0,49)
NTNB	106.550.594,98	950.681,72	68.923,42	5,73%	3.678.326,58	(1.245.491,88)	(6.897.036,65)
Total	230.250.292,96	3.829.912,10	1.203.894,67	100,00%	3.492.646,55	(1.291.289,81)	(6.533.646,98)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIM EMB VI A CRED PRIV CNPJ - 41837660000109

Dados Gerais

PL:	164.813.332,61	VAR / PL:	0,988%
VAR:	1.627.969,60	ETL / PL:	1,2387%
ETL:	2.041.540,25	VAR / CDI:	2014,31%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(6.918.995,90)	BAIXA 1:	5.900.450,24	Cenário 1:	6.276.346,58
				Cenário 2:	(2.529.307,54)
				Cenário 3:	(10.716.117,48)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	10.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(48.243,67)	-	-	0,00%	-	-	-
DAPQ22	-	152.634,60	115.757,47	7,11%	48.578,60	(17.579,15)	(105.299,40)
DAPK23	-	374.828,40	255.996,36	15,72%	267.946,47	(96.861,04)	(579.314,52)
D11F24	-	16.995,15	13.233,44	0,81%	88.455,26	(44.727,93)	(130.312,25)
DAPQ24	-	250.551,79	201.377,71	12,37%	564.928,48	(202.989,31)	(1.204.239,92)
D11F25	-	378.633,97	290.210,34	17,83%	1.680.367,23	(838.982,84)	(2.424.016,42)
DAPK25	-	73.502,15	63.283,16	3,89%	-	-	-
D11N25	-	79.850,09	62.320,61	3,83%	347.275,68	(172.270,20)	(495.625,02)
D11F26	-	52.390,73	(43.627,55)	-2,68%	(216.715,08)	106.728,36	305.615,66
DAPQ26	-	87.368,92	74.560,53	4,58%	-	-	-
DAPQ28	-	186.452,53	(152.774,41)	-9,38%	-	-	-
D11F29	-	59.133,14	51.530,30	3,17%	225.186,59	(106.181,97)	(295.690,71)
DAPQ30	-	1,19	(1,07)	0,00%	(3,92)	1,36	7,69
DAPK35	-	16.129,14	(13.679,11)	-0,84%	-	-	-
COMPROMISSADA	24.542.711,98	371,88	(47,17)	0,00%	1.872,96	(968,49)	(2.863,74)
DE252 ALIANSCE CDI - ALSA0	4.088.863,88	16.688,51	13.973,28	0,86%	65.913,23	(32.254,98)	(91.970,90)
DE252 AUTOPIST CDI - APRB28	1.311.865,86	163,22	90,17	0,01%	847,69	(423,16)	(1.222,68)
DE252 BCBF CDI - BCBF15	2.618.358,11	438,12	247,44	0,02%	2.567,91	(1.296,16)	(3.772,14)
DE252 BKBR CDI - BKBR18	1.465.843,89	114,35	24,96	0,00%	653,68	(331,47)	(967,57)
DE252 BRASKEM CDI - BRKMB6	559.253,68	890,65	761,11	0,05%	3.747,47	(1.798,52)	(5.068,77)
DE252 BRKA CDI - BRKPA0	2.428.410,21	1.535,35	1.193,74	0,07%	7.282,40	(3.617,51)	(10.418,80)
DE252 BRML CDI - BRML17	3.251.695,64	2.139,06	(1.740,40)	-0,11%	(9.120,71)	4.580,39	13.285,59
DE252 CCPR CDI - CCPRA3	2.184.007,25	1.673,74	(1.079,51)	-0,07%	(4.266,75)	2.030,40	5.674,84
DE252 CEA MODA CDI - CEAB11	1.716.657,23	223,80	109,82	0,01%	1.340,13	(677,90)	(1.975,62)
DE252 CEA MODA CDI - CEAB22	549.436,88	303,41	236,25	0,01%	1.458,69	(724,16)	(2.084,99)
DE252 CELPA CDI - CELP15	2.583.036,92	138,41	(99,41)	-0,01%	82,71	(42,54)	(125,36)
DE252 CORSAN CDI - RSAN24	1.640.322,60	7.932,68	6.395,14	0,39%	33.224,04	(16.597,48)	(47.936,80)
DE252 COSAN LO CDI - RLOG11	1.587.803,63	219,40	110,99	0,01%	1.307,28	(660,72)	(1.924,52)
DE252 CSAN CDI - CSAN23	1.158.743,04	1.556,70	1.322,27	0,08%	6.614,53	(3.192,88)	(9.030,74)
DE252 DASA CDI - DASAA2	2.657.334,44	158,25	(12,64)	0,00%	771,33	(391,53)	(1.143,68)
DE252 ECORODOV CDI - ERDVA0	2.203.990,67	120,29	(66,80)	0,00%	370,08	(189,78)	(558,11)
DE252 ELEKTRO CDI - ELEK27	558.515,54	149,43	(120,31)	-0,01%	(1.087,61)	558,97	1.646,15
DE252 ENERG TR CDI - ETEN13	4.649.205,71	35.938,70	31.191,14	1,92%	157.294,91	(75.592,80)	(213.284,37)
DE252 GUAR CDI - GUAR15	2.685.620,66	1.159,60	860,72	0,05%	5.813,64	(2.902,93)	(8.389,11)
DE252 IGUATEMI CDI - IGTA37	2.165.964,35	1.467,83	(1.188,20)	-0,07%	(6.424,71)	3.245,43	9.449,62
DE252 LIGHT CDI - LIGHB4	2.114.799,27	136,75	(3,28)	0,00%	801,90	(408,41)	(1.195,62)
DE252 LIGHT CDI - LIGHD3	1.666.958,20	1.247,21	1.012,93	0,06%	5.640,46	(2.776,62)	(7.950,86)
DE252 LOCAMERI CDI - LCAMA9	2.018.708,05	484,71	316,18	0,02%	2.647,90	(1.332,53)	(3.870,31)
DE252 MOV_PART CDI - MOV127	1.213.236,80	1.471,12	1.222,01	0,08%	6.498,92	(3.185,42)	(9.096,69)
DE252 MULTIPLA CDI - MULP16	3.153.354,13	1.496,56	(1.237,48)	-0,08%	(6.765,72)	3.433,06	10.025,46



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIM EMB VI A CRED PRIV CNPJ - 41837660000109

Dados Gerais

PL:	164.813.332,61	VAR / PL:	0,988%
VAR:	1.627.969,60	ETL / PL:	1,2387%
ETL:	2.041.540,25	VAR / CDI:	2014,31%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(6.918.995,90)	BAIXA 1:	5.900.450,24	Cenário 1:	6.276.346,58
				Cenário 2:	(2.529.307,54)
				Cenário 3:	(10.716.117,48)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 OMEGA GE CDI - OMGE13	4.055.074,29	2.523,54	2.038,15	0,13%	11.559,03	(5.686,85)	(16.279,23)
DE252 OURO VER CDI - OVSA10	1.520.602,55	507,93	357,91	0,02%	2.650,40	(1.329,37)	(3.852,79)
DE252 RD COLIN CDI - RDCO10	3.200.742,74	18.089,43	14.687,50	0,90%	73.062,63	(36.504,34)	(105.364,24)
DE252 RENNEN CDI - LRENB1	1.431.405,40	115,23	27,72	0,00%	666,54	(337,79)	(985,62)
DE252 RT BANDE CDI - CBAN22	2.291.250,96	713,23	512,97	0,03%	3.622,88	(1.808,95)	(5.227,52)
DE252 S LUIZ A CDI - RDORB9	1.147.727,17	1.477,12	1.253,90	0,08%	6.281,73	(3.031,99)	(8.575,28)
DE252 SANEAMEN CDI - SNGO18	2.583.387,88	354,89	181,64	0,01%	2.100,18	(1.060,67)	(3.087,95)
DE252 SBF COME CDI - SBFC11	3.262.154,44	16.324,51	11.942,98	0,73%	71.646,40	(36.298,52)	(105.758,77)
DE252 UNIGEL P CDI - UGEL11	883.311,77	310,23	224,57	0,01%	1.574,35	(786,66)	(2.274,38)
DE252 VERT-10 CDI - VCCS11	1.919.453,81	2.048,74	1.715,80	0,11%	8.890,39	(4.335,06)	(12.338,76)
DE252 VIX LOGI CDI - VIXL14	2.139.274,46	460,90	290,86	0,02%	2.595,98	(1.307,20)	(3.798,34)
LF selic	2.065.162,66	2.898,16	(2.293,55)	-0,14%	(12.957,51)	6.732,90	19.973,50
LF252 ABC CDI - LF002100BMM	1.106.972,62	57,13	(41,87)	0,00%	0,01	-	(0,01)
LF252 ABC CDI - LF002100BMX	1.106.972,62	57,13	(41,87)	0,00%	0,01	-	(0,01)
LF252 CNH CDI - LF0021003Q1	2.061.313,74	106,39	(77,97)	0,00%	0,01	0,00	(0,02)
LF252 LAGE CDI - LF002200IO9	2.043.606,28	105,48	(77,30)	0,00%	0,01	(0,00)	(0,02)
LF252 PANAMERI CDI - LF002100E1F	1.104.965,44	57,03	(41,79)	0,00%	0,01	-	(0,01)
LF252 PARANA B CDI - LF002100BC4	1.669.321,76	86,16	(63,14)	0,00%	0,01	-	(0,02)
LFSN BRADESCO CDI - LFSN210029N	3.637.907,56	187,76	(137,60)	-0,01%	0,02	0,00	(0,03)
DE252 LOCAMERI IPCA - LCAMD1	4.410.934,69	63.650,07	61.047,72	3,75%	229.116,83	(78.280,61)	(426.185,97)
DE252 SIMPAR IPCA M D - JSMLB5	2.827.798,43	40.729,65	39.083,61	2,40%	149.165,98	(52.511,48)	(272.012,47)
DE252 VAMOS IPCA - VAMO33	1.234.405,30	17.926,79	17.125,19	1,05%	65.332,41	(22.292,92)	(122.229,70)
DEBI CART IPCA - CART13	1.599.533,86	22.352,00	21.104,49	1,30%	87.599,53	(29.938,61)	(159.843,34)
DEBI CORSAN IPCA - RSNAN44	745.472,45	8.152,33	7.812,44	0,48%	28.225,45	(9.509,72)	(55.793,54)
DEBI ECHOENER IPCA - ECHP22	1.471.457,49	15.751,33	15.051,39	0,92%	54.541,44	(18.484,81)	(108.765,67)
DEBI ENSINOP IPCA - CSNP12	1.663.289,71	19.859,30	19.323,16	1,19%	73.676,11	(26.091,80)	(137.704,50)
DEBI GBS PART IPCA - GBSP11	2.377.135,42	41.979,64	36.089,72	2,22%	171.637,75	(57.169,11)	(283.172,80)
DEBI HAZTEC IPCA - HZTC14	2.150.660,23	29.136,34	27.566,08	1,69%	114.131,82	(38.966,40)	(208.683,39)
DEBI HOLDARAG IPCA - HARG11	3.001.726,38	42.901,44	39.378,57	2,42%	170.938,15	(57.587,76)	(305.545,09)
DEBI METRORIO IPCA - MTRJ19	2.679.413,29	30.907,16	30.257,59	1,86%	107.036,98	(37.437,78)	(204.370,14)
DEBI NORTE EN IPCA - NTEN11	2.785.791,21	30.132,55	28.875,02	1,77%	109.773,44	(38.774,96)	(212.065,34)
DEBI PARANAGU IPCA - PASN12	2.015.246,76	17.919,75	17.177,12	1,06%	57.806,85	(20.132,78)	(114.228,51)
DEBI TUCANOHO IPCA - TNHL11	803.930,45	11.970,26	10.667,04	0,66%	49.444,46	(16.483,79)	(87.406,59)
DEBI UTE GNA IPCA - UNEG11	4.436.231,55	71.269,85	61.829,45	3,80%	279.813,75	(90.648,29)	(491.275,36)
LF ipca	3.496.504,65	69.244,88	58.675,74	3,60%	312.425,10	(107.423,77)	(60.155,14)
NTNB	10.533.515,23	144.755,52	129.329,90	7,94%	694.751,47	(233.437,98)	(1.280.331,69)
BR ELETRO FIDC S1	4.108.139,99	4.452,95	3.353,23	0,21%	83.474,46	-	(110.775,36)
FARM SYN AGRO FIDC	3.443.945,71	3.133,11	(2.304,43)	-0,14%	(32.186,04)	-	44.224,77
FIDC VERDECARD SN4	1.462.367,08	436,22	328,87	0,02%	15.277,34	-	(20.507,51)
RB CAP CREDIT AL SN4	833.815,05	6.592,65	4.078,06	0,25%	(2.435,47)	-	3.320,99
Total	174.048.378,01	2.546.426,33	1.627.969,60	100,00%	6.276.346,58	(2.529.307,54)	(10.716.117,48)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIM EMB VII A CRED PRIV CNPJ - 41687175000104

Dados Gerais

PL:	282.016.851,75	VAR / PL:	1,089%
VAR:	3.070.542,79	ETL / PL:	1,3654%
ETL:	3.850.585,86	VAR / CDI:	2220,30%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(12.645.764,97)	BAIXA 1:	10.684.761,13	Cenário 1:	11.860.058,34
				Cenário 2:	(3.897.678,74)
				Cenário 3:	(22.029.340,74)

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	999,96	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(131.332,35)	-	-	0,00%	-	-	-
CNRD11	78.302,00	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	2.856.849,11	43,29	1,06	0,00%	218,02	(112,73)	(333,35)
DE252 CSAN IPCA - CSAN33	3.047.263,18	43.121,21	42.721,81	1,39%	153.322,16	(51.465,54)	(288.819,10)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	5.544.579,33	49.606,81	38.502,93	1,25%	123.401,31	(44.437,33)	(257.171,27)
DE252 IRB IPCA - IRBR12	9.116.279,20	82.625,14	76.198,05	2,48%	288.950,20	(102.712,47)	(581.816,25)
DE252 LIGHT IPCA - LIGHD7	4.995.966,27	44.279,54	40.611,42	1,32%	142.147,10	(49.904,51)	(292.060,00)
DE252 LOCALIZA IPCA - LORTA7	8.434.993,67	126.237,23	125.292,77	4,08%	441.972,73	(146.804,33)	(832.744,89)
DE252 LOCAMERI IPCA - LCAMD1	4.352.489,80	62.806,70	62.227,94	2,03%	226.081,04	(77.243,39)	(420.539,01)
DE252 MOV_PART IPCA - MOVI37	1.153.339,17	16.617,24	16.433,15	0,54%	60.638,25	(21.213,04)	(111.048,58)
DE252 MOVIDA L IPCA - MVLV16	6.360.683,60	95.352,31	88.773,04	2,89%	358.624,92	(125.960,39)	(725.091,24)
DE252 VAMOS IPCA - VAMO33	5.230.530,93	75.960,99	75.033,07	2,44%	276.832,26	(94.461,52)	(517.922,47)
DE252 VAMOS IPCA - VAMO34	2.284.900,16	33.463,35	33.117,25	1,08%	123.396,10	(43.190,58)	(225.422,12)
DEBI AESTUCAN IPCA - TCII11	7.810.189,57	118.432,96	114.330,48	3,72%	484.288,20	(158.439,70)	(857.683,78)
DEBI ANEMUS IPCA - ANEM11	11.720.028,45	165.380,60	162.207,47	5,28%	641.130,51	(218.322,77)	(1.124.857,48)
DEBI ANET IPCA - ANET11	5.887.822,81	56.476,54	51.689,15	1,68%	165.885,22	(57.864,81)	(334.778,60)
DEBI B2W IPCA - BTOW15	6.465.560,52	98.936,74	98.043,07	3,19%	359.984,17	(123.988,79)	(662.225,25)
DEBI BRISANET IPCA - BRST11	5.899.155,15	54.793,36	51.616,79	1,68%	186.771,94	(65.395,35)	(376.520,18)
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	6.777.979,52	99.721,01	97.660,71	3,18%	373.546,25	(117.928,52)	(707.660,01)
DEBI CAGECE IPCA - CAEC21	4.845.770,33	56.268,39	43.419,91	1,41%	108.015,28	(21.313,39)	(279.587,31)
DEBI CART IPCA - CART13	4.830.592,26	67.503,03	67.226,85	2,19%	264.550,59	(90.414,61)	(482.726,89)
DEBI CEEE D IPCA - CEED21	4.034.645,89	49.435,05	48.340,08	1,57%	176.605,78	(59.871,81)	(342.670,81)
DEBI CELP IPCA - CEPEC1	2.093.750,78	30.728,44	30.498,09	0,99%	110.785,25	(37.248,55)	(207.757,89)
DEBI COELBA IPCA - CEIBC3	2.088.185,80	30.649,64	30.421,84	0,99%	110.418,10	(37.075,56)	(207.243,62)
DEBI COMGAS IPCA - GASP19	3.473.384,35	46.905,33	46.468,85	1,51%	161.870,64	(53.444,98)	(308.252,09)
DEBI CORSAN IPCA - RSNAN4	4.789.660,47	52.378,71	51.164,37	1,67%	181.348,53	(61.099,97)	(358.473,53)
DEBI EDPM IPCA - MGSP12	4.840.732,03	61.846,01	60.300,54	1,96%	240.151,42	(75.058,13)	(448.116,53)
DEBI ENERGISA IPCA - ENGIA5	2.962.661,90	43.465,28	43.127,72	1,40%	157.171,63	(53.124,40)	(293.763,73)
DEBI GBS PART IPCA - GBSP11	4.048.649,14	71.498,17	67.129,86	2,19%	292.327,08	(97.368,32)	(482.289,44)
DEBI HIDRO BR IPCA - HBSA21	4.117.743,95	60.415,70	59.949,89	1,95%	218.335,69	(73.720,50)	(408.355,77)
DEBI HOLDARAG IPCA - HARG11	8.910.387,78	127.349,54	125.099,42	4,07%	507.416,40	(170.944,73)	(906.986,48)
DEBI IP SUL C IPCA - IPIL11	4.547.604,66	50.636,89	49.554,23	1,61%	175.113,13	(60.839,76)	(324.717,04)
DEBI LAME IPCA - LAMEA6	6.749.110,83	101.468,95	100.307,59	3,27%	364.195,65	(126.762,12)	(668.287,50)
DEBI METRORIO IPCA - MTRJ19	7.904.668,79	91.180,74	89.286,51	2,91%	315.775,05	(110.447,04)	(602.922,38)
DEBI MG050 IPCA - CRMG15	4.078.894,75	46.222,68	45.190,72	1,47%	159.621,15	(54.911,05)	(309.927,05)
DEBI NORTE EN IPCA - NTEN11	3.286.109,80	35.544,25	34.591,04	1,13%	129.488,37	(45.738,81)	(250.151,55)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS11	3.360.099,91	31.395,28	29.113,66	0,95%	98.130,08	(34.571,63)	(197.150,66)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS21	3.369.558,24	53.589,25	52.375,82	1,71%	213.725,57	(73.356,46)	(374.055,50)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS22	2.374.188,18	35.349,68	35.171,63	1,15%	130.296,40	(43.417,47)	(242.627,56)
DEBI PARANAGU IPCA - PASN12	7.095.429,49	63.093,18	59.562,57	1,94%	203.530,61	(70.884,98)	(402.184,17)
DEBI QUATA IPCA - QUAT12	4.805.167,88	40.939,17	36.073,11	1,17%	133.592,83	(47.986,22)	(271.733,61)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIM EMB VII A CRED PRIV CNPJ - 41687175000104

Dados Gerais

PL:	282.016.851,75	VAR / PL:	1,089%
VAR:	3.070.542,79	ETL / PL:	1,3654%
ETL:	3.850.585,86	VAR / CDI:	2220,30%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(12.645.764,97)	BAIXA 1:	10.684.761,13	Cenário 1:	11.860.058,34
				Cenário 2:	(3.897.678,74)
				Cenário 3:	(22.029.340,74)

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
DEBI RT BANDE IPCA - CBAN32	1.376.541,90	18.373,69	18.259,32	0,59%	70.659,49	(23.116,65)	(132.369,31)
DEBI RT BANDE IPCA - CBAN72	4.957.453,90	66.170,70	65.758,79	2,14%	254.471,84	(83.251,89)	(476.712,51)
DEBI TAUBATE IPCA - LTTE15	10.001.736,18	123.655,59	120.629,76	3,93%	428.004,30	(138.652,97)	(797.638,21)
DEBI TESC IPCA - CJEN13	10.784.589,68	150.825,00	149.809,47	4,88%	605.004,94	(212.481,25)	(1.078.865,02)
DEBI TUCANOHO IPCA - TNHL11	5.334.159,75	79.423,92	77.110,03	2,51%	328.069,00	(109.371,61)	(579.951,53)
DEBI UHESIMAO IPCA - UHSM12	5.393.989,17	73.985,95	61.022,96	1,99%	300.408,80	(88.546,76)	(566.459,89)
DEBI VENSJOR IPCA - VSJH11	1.266.545,59	10.707,59	10.054,56	0,33%	35.628,74	(12.939,79)	(69.648,95)
DEBI VIA BRAS IPCA - VIMT13	6.074.931,86	83.008,02	82.519,37	2,69%	325.226,18	(108.927,00)	(595.024,82)
DEBI VIARONDO IPCA - VRDN12	7.041.764,03	95.242,95	95.024,79	3,09%	367.393,02	(121.898,86)	(687.616,97)
FIDC CELG DIST SN B	2.370.675,33	81.222,63	31.352,72	1,02%	146.509,24	554,30	(185.520,06)
FIDC CREDZ SN3	211.780,16	38.250,75	(26.212,56)	-0,85%	-	-	-
FIDC VERDECARD SN4	4.417.741,31	1.317,79	891,20	0,03%	46.152,11	-	(61.952,22)
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	799.194,96	24.103,36	5.487,90	0,18%	92.875,06	-	(110.906,53)
Total	256.524.681,09	3.318.006,31	3.070.542,79	100,00%	11.860.058,34	(3.897.678,74)	(22.029.340,74)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIM EMB III A IMOBILIÁRIO CNPJ - 32711990000162

Dados Gerais

PL:	88.867.446,34	VAR / PL:	0,884%
VAR:	785.165,67	ETL / PL:	1,1080%
ETL:	984.629,76	VAR / CDI:	1801,73%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(29,34)	BAIXA 1:	29,85	Cenário 1:	196.064,09
				Cenário 2:	(281,29)
				Cenário 3:	(188.990,51)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	18,89	(2,14)	0,00%	2,09	0,01	(2,83)
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(130.018,30)	2.455,54	278,80	0,04%	(271,75)	(1,06)	368,37
AIEC11	3.489.397,31	189.221,61	(85.417,28)	-10,88%	126.537,70	28,40	(165.637,28)
BLCP11	1.332.673,02	53.573,52	(4.468,25)	-0,57%	2.219,89	10,85	(3.006,91)
BMLC11	2.119.669,05	97.019,78	31.690,28	4,04%	(53.242,58)	17,25	74.960,06
BPML11	986.459,10	93.793,85	(34.551,63)	-4,40%	60.936,23	231,00	(77.520,89)
CEOC11	856.200,00	56.817,37	(24.792,35)	-3,16%	27.553,75	105,94	(36.234,73)
CNES11	509.934,48	37.096,36	(21.747,55)	-2,77%	23.603,64	90,14	(30.550,24)
GALG11	2.147.103,88	49.198,77	(21.756,54)	-2,77%	26.149,26	17,48	(35.172,86)
HBRH11	1.917.316,80	50.647,75	(7.186,83)	-0,92%	35.616,81	15,61	(47.566,16)
HSML11	8.640.590,09	404.845,04	124.041,17	15,80%	103.015,29	399,94	(138.602,81)
LVB11	3.504.153,42	81.693,27	(35.834,37)	-4,56%	61.438,50	237,89	(82.147,60)
MALL11	5.082.099,66	112.080,06	(146,72)	-0,02%	(11.256,43)	(44,11)	15.483,54
MAXR11	1.326.803,75	73.617,28	(53.143,90)	-6,77%	89.281,78	337,57	(112.891,55)
NEWU11	413.981,64	83.671,87	(52.366,76)	-6,67%	75.323,90	3,37	(84.502,79)
PATC11	8.588.810,37	269.784,94	159.849,91	20,36%	(172.939,06)	(682,66)	242.039,99
QAGR11	8.248.836,48	404.701,33	244.907,41	31,19%	(99.107,36)	67,15	137.406,91
RBRL11	2.998.297,06	82.562,72	(5.972,66)	-0,76%	14.774,54	24,41	(20.017,60)
RCRB11	2.170.043,64	170.146,23	109.234,21	13,91%	(97.608,23)	(390,20)	140.788,79
RNGO11	122.774,04	6.315,91	(1.365,44)	-0,17%	5.032,84	19,27	(6.552,90)
SDIL11	368.756,18	14.828,91	(2.780,57)	-0,35%	8.313,37	32,11	(11.052,72)
TEPP11	8.034.092,58	321.016,55	231.858,59	29,53%	(114.067,41)	(448,96)	158.541,80
TRXF11	13.019.117,30	272.267,62	90.907,61	11,58%	(92.015,09)	(360,98)	126.898,23
VISC11	696.496,00	18.111,15	11.927,16	1,52%	(6.260,85)	(24,58)	8.651,47
VVPR11	1.385.371,26	45.427,57	(14.524,79)	-1,85%	(1.287,92)	11,28	1.780,15
XPIN11	3.163.191,60	56.283,60	37.388,82	4,76%	71.454,93	25,75	(94.995,29)
XPPR11	3.120.142,47	161.134,93	67.737,80	8,63%	91.520,22	25,40	(120.743,63)
COMPROMISSADA	1.048.110,38	19.784,88	(2.238,79)	-0,29%	2.270,63	(32,83)	(3.091,83)
FII HSI LOGISTICA	2.432.266,41	53.656,41	26.155,90	3,33%	23.288,67	19,80	(31.413,38)
FII VIA PQ SHOPPING	1.262.973,00	31.879,53	17.484,58	2,23%	(4.213,25)	(16,51)	5.794,16
Total	88.856.642,67	3.313.653,25	785.165,67	100,00%	196.064,09	(281,29)	(188.990,51)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	206.640.444,68	VAR / PL:	11,346%
VAR:	23.444.797,74	ETL / PL:	14,2280%
ETL:	29.400.732,30	VAR / CDI:	23136,78%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(121,58)	BAIXA 1:	123,68	Cenário 1:	25.925.403,93
				Cenário 2:	88.805,86
				Cenário 3:	(29.383.291,17)

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	10.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	5.601.516,23	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	5.512.827,00	447.130,27	257.836,49	1,10%	408.914,22	1.538,07	(510.794,63)
AMER3	1.056.256,07	413.658,43	290.480,12	1,24%	684.286,65	-	(520.455,68)
B3SA3	7.186.789,84	1.066.694,34	617.666,64	2,63%	607.076,67	2.272,47	(749.883,08)
Banco BTG Pactual SA UNT	4.473.155,00	604.966,25	526.597,06	2,25%	659.174,96	2.397,95	(762.190,18)
BBAS3	7.517.176,00	1.119.442,01	1.015.244,88	4,33%	1.007.222,90	3.686,01	(1.180.718,22)
BBDC4	13.501.656,00	2.048.468,62	1.916.445,03	8,17%	1.938.028,59	7.062,16	(2.249.667,12)
BBSE3	2.575.232,00	232.927,93	158.389,74	0,68%	107.776,21	411,66	(139.551,64)
BEEF3	1.163.779,00	140.163,00	82.723,40	0,35%	(7.173,07)	(28,05)	9.818,83
CIEL3	990.375,00	183.810,42	145.665,75	0,62%	15.149,22	58,62	(20.221,10)
CPFE3	4.422.016,00	904.539,22	593.988,66	2,53%	673.123,58	2.443,42	(774.481,49)
CSED3	826.440,00	153.041,91	102.146,97	0,44%	151.048,23	-	(168.559,04)
ELET3	5.447.996,40	530.418,77	279.678,39	1,19%	7.587,89	29,56	(10.294,26)
ELET6	3.212.960,00	289.934,04	93.224,10	0,40%	(61.510,42)	(242,12)	85.515,14
EZTC3	981.155,00	153.230,47	126.941,02	0,54%	165.645,55	596,91	(187.426,72)
GGBR4	5.073.450,00	1.288.750,93	1.211.535,67	5,17%	1.515.935,65	5.173,80	(1.517.039,30)
GMAT3	2.127.372,00	545.657,89	468.531,82	2,00%	855.677,29	2.805,67	(783.574,00)
HAPV3	3.082.279,36	527.914,25	46.518,60	0,20%	514.552,12	1.855,75	(583.312,95)
HYPE3	2.487.816,00	310.427,09	281.415,95	1,20%	153.394,47	580,39	(194.269,21)
INTB3	1.771.707,00	124.096,32	49.766,11	0,21%	120.670,94	-	(151.741,81)
ITSA4	5.401.609,50	591.774,37	552.948,69	2,36%	631.297,92	2.328,20	(753.339,86)
ITUB4	14.289.739,79	1.900.434,85	1.833.955,19	7,82%	1.905.420,72	6.975,06	(2.235.125,93)
JBSS3	6.832.917,00	589.597,06	418.482,00	1,78%	609.764,74	2.277,49	(749.335,52)
LREN3	3.778.671,00	665.152,91	603.819,61	2,58%	665.727,03	2.391,31	(747.766,72)
LWSA3	1.791.094,00	514.563,99	281.404,72	1,20%	413.757,45	1.451,86	(440.692,65)
MOVI3	779.085,00	222.054,41	189.160,30	0,81%	246.445,85	835,26	(242.817,61)
MULT3	2.691.070,00	375.791,74	217.380,82	0,93%	239.066,89	893,09	(293.914,93)
PETR3	7.497.570,00	1.541.293,03	1.281.369,67	5,47%	1.115.854,60	4.056,62	(1.288.313,08)
PETR4	14.706.792,87	3.078.089,35	2.497.223,23	10,65%	2.115.469,79	7.707,71	(2.454.880,20)
PETZ3	1.990.965,00	321.648,96	63.673,44	0,27%	309.938,60	1.123,35	(355.363,55)
PRI03	2.018.682,00	494.037,40	395.485,78	1,69%	550.556,76	1.898,89	(564.088,91)
RADL3	3.390.720,00	546.902,15	125.729,49	0,54%	86.485,89	332,97	(114.088,20)
RDOR3	1.979.334,00	349.488,13	232.116,84	0,99%	375.392,99	-	(416.082,25)
RENT3	3.401.409,00	451.811,27	387.945,48	1,65%	477.915,86	1.743,88	(556.493,27)
STBP3	3.589.260,00	729.420,75	612.340,36	2,61%	740.130,79	2.624,43	(807.236,28)
SUZB3	4.869.620,00	518.849,10	391.619,47	1,67%	511.226,99	1.895,64	(617.757,27)
TIMS3	2.976.908,00	371.555,96	317.208,21	1,35%	389.704,86	1.428,13	(458.288,96)
TOTS3	2.732.654,58	529.470,05	336.576,32	1,44%	448.651,44	1.620,03	(510.013,84)
VALE3	34.283.185,20	5.452.456,32	4.555.989,24	19,43%	4.571.062,98	16.733,08	(5.362.070,52)
WEGE3	4.271.675,00	602.411,12	(114.430,52)	-0,49%	4.618,67	18,00	(6.268,31)
COMPROMISSADA	4.343.399,10	65,81	3,02	0,00%	331,46	(171,40)	(506,80)
Total	206.638.314,94	30.932.140,92	23.444.797,74	100,00%	25.925.403,93	88.805,86	(29.383.291,17)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	89.601.674,46	VAR / PL:	9,897%
VAR:	8.867.827,99	ETL / PL:	12,4112%
ETL:	11.120.617,87	VAR / CDI:	20182,40%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(42,53)	BAIXA 1:	43,27	Cenário 1:	11.258.150,10
				Cenário 2:	31.042,73
				Cenário 3:	(12.458.455,36)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	2.151.995,16	-	-	0,00%	-	-	-
ALSO3	2.393.495,00	300.772,88	266.893,81	3,01%	404.966,84	1.459,09	(458.048,65)
AMER3	247.112,00	96.775,74	76.462,69	0,86%	160.089,44	-	(121.761,05)
AURE3	5.473.782,66	957.294,44	(346.395,93)	-3,91%	-	-	-
Banco BTG Pactual SA UNT	2.659.352,00	359.660,73	332.204,84	3,75%	391.888,55	1.425,61	(453.132,52)
BBAS3	734.360,00	109.359,34	93.871,66	1,06%	98.396,55	360,09	(115.345,47)
BMGB4	159.900,00	15.680,28	12.014,69	0,14%	16.631,72	61,70	(20.118,16)
BRML3	4.541.455,84	488.720,26	302.385,61	3,41%	606.075,89	2.218,51	(710.866,07)
CLSA3	103.522,00	24.939,17	(1.515,14)	-0,02%	16.433,21	-	(18.783,35)
CSED3	131.823,00	24.411,26	16.266,05	0,18%	24.093,26	-	(26.886,35)
CYRE3	484.986,42	92.836,54	74.042,36	0,83%	101.306,88	358,82	(110.206,59)
ELET3	1.514.066,40	147.410,02	87.795,92	0,99%	2.108,77	8,22	(2.860,90)
ELET6	2.848.700,00	257.063,61	107.940,14	1,22%	(54.536,86)	(214,67)	75.820,11
ENEV3	4.334.433,74	531.651,91	457.629,21	5,16%	221.705,03	843,05	(284.085,16)
ENJU3	138.822,00	68.964,19	58.777,61	0,66%	124.651,96	-	(80.704,80)
EQTL3	6.257.497,64	393.984,56	187.613,52	2,12%	173.270,52	666,37	(227.998,74)
ESPA3	64.988,00	22.530,39	12.598,79	0,14%	19.330,33	-	(19.367,83)
EUCATEX PN	124.972,00	36.247,92	30.703,89	0,35%	38.551,23	131,07	(38.248,16)
GGBR4	1.488.510,00	378.109,30	346.537,05	3,91%	444.763,50	1.517,95	(445.087,30)
HAPV3	1.190.758,83	203.946,00	38.188,27	0,43%	198.783,89	716,92	(225.347,86)
HYPE3	1.982.644,80	247.392,35	224.531,63	2,53%	122.246,48	462,54	(154.821,27)
IGTH1	1.274.951,30	204.011,43	151.410,70	1,71%	-	-	-
ITSA4	4.705.428,00	515.504,07	471.659,08	5,32%	549.933,66	2.028,13	(656.246,34)
ITUB4	396.725,00	52.761,63	50.022,86	0,56%	52.900,06	193,65	(62.053,64)
LCAM3	1.538.779,00	177.310,46	161.206,57	1,82%	174.960,44	646,18	(209.480,45)
LREN3	5.099.136,12	897.592,10	847.390,87	9,56%	898.366,85	3.226,95	(1.009.075,50)
LWSA3	215.246,00	61.838,09	29.778,46	0,34%	49.723,60	174,48	(52.960,55)
MDNE3	84.810,00	20.291,58	18.119,79	0,20%	21.594,19	75,03	(22.496,86)
MRVE3	190.564,00	32.473,84	29.078,34	0,33%	46.759,88	163,10	(49.135,48)
NEXP3	14.784,00	-	-	0,00%	-	-	-
NINJ3	240.381,00	86.202,95	74.292,67	0,84%	113.498,61	-	(98.257,55)
NTCO3	3.176.849,50	724.102,34	526.097,13	5,93%	731.514,49	2.567,66	(779.684,30)
ONCO3	637.488,00	143.963,95	78.072,09	0,88%	179.174,31	-	(182.191,21)
PARD3	593.403,15	101.998,95	88.802,71	1,00%	94.305,18	341,31	(107.772,22)
PETRA	904.932,00	189.399,66	136.959,09	1,54%	130.168,17	474,27	(151.052,62)
PRI03	2.003.289,00	490.270,23	368.585,87	4,16%	546.358,62	1.884,42	(559.787,58)
RAIL3	1.787.362,40	293.775,71	160.391,53	1,81%	60.725,44	232,83	(79.334,32)
RDOR3	846.216,00	149.415,13	89.954,68	1,01%	160.490,12	-	(177.885,82)
RECV3	3.771.182,48	940.172,21	788.483,59	8,89%	751.160,27	-	(824.864,97)
RENT3	4.909.087,47	652.077,14	601.786,37	6,79%	689.752,62	2.516,85	(803.159,55)
SEER3	499.266,28	68.214,31	52.780,32	0,60%	100.512,03	357,15	(110.145,56)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	89.601.674,46	VAR / PL:	9,897%
VAR:	8.867.827,99	ETL / PL:	12,4112%
ETL:	11.120.617,87	VAR / CDI:	20182,40%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(42,53)	BAIXA 1:	43,27	Cenário 1:	11.258.150,10
				Cenário 2:	31.042,73
				Cenário 3:	(12.458.455,36)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
SOMA3	2.293.679,60	401.814,62	329.743,40	3,72%	396.952,83	1.427,80	(447.254,58)
SULA11	613.562,30	111.779,47	84.438,94	0,95%	105.523,69	379,74	(119.023,45)
SUZB3	5.360.358,44	571.136,39	381.484,95	4,30%	562.746,16	2.086,67	(680.012,08)
TEND3	464.490,00	81.716,44	(4.120,97)	-0,05%	103.534,34	364,54	(111.126,73)
VBBR3	5.736.476,16	672.255,98	615.086,68	6,94%	1.046.569,53	-	(1.168.275,81)
YDUQ3	1.699.100,00	406.624,57	357.775,49	4,03%	580.051,88	1.946,67	(559.150,79)
COMPROMISSADA	1.519.428,73	23,02	0,10	0,00%	115,95	(59,96)	(177,29)
Total	89.605.153,42	12.804.477,18	8.867.827,99	100,00%	11.258.150,10	31.042,73	(12.458.455,36)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIA RVA EMB IV CNPJ - 38452613000132

Dados Gerais

PL:	78.793.954,19	VAR / PL:	9,625%
VAR:	7.583.711,42	ETL / PL:	12,0698%
ETL:	9.510.283,34	VAR / CDI:	19627,30%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(116,46)	BAIXA 1:	118,47	Cenário 1:	9.120.241,28
				Cenário 2:	28.790,32
				Cenário 3:	(10.047.161,42)

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	533.441,14	-	-	0,00%	-	-	-
AURE3	3.529.350,60	617.238,19	(211.185,35)	-2,78%	-	-	-
Banco BTG Pactual SA UNT	5.591.332,20	756.192,73	658.140,34	8,68%	823.952,26	2.997,37	(952.718,72)
BRML3	3.696.358,24	397.776,66	227.056,24	2,99%	493.294,15	1.805,68	(578.584,43)
ELET3	4.547.142,60	442.711,34	228.655,56	3,02%	6.333,19	24,67	(8.592,06)
ELET6	523.647,10	47.253,35	15.135,97	0,20%	(10.024,95)	(39,46)	13.937,23
ENEV3	2.642.589,32	324.134,07	272.467,58	3,59%	135.167,68	513,99	(173.199,19)
EQTL3	11.179.677,52	703.894,84	373.782,71	4,93%	309.566,01	1.190,55	(407.343,73)
GGPS3	2.821.829,60	564.946,71	470.139,35	6,20%	746.256,06	-	(770.417,62)
GMAT3	2.520.330,80	646.449,42	565.940,56	7,46%	1.013.734,24	3.323,92	(928.312,35)
HAPV3	3.356.971,82	574.961,92	117.720,77	1,55%	560.408,96	2.021,14	(635.297,75)
ITUB4	4.467.894,28	594.198,50	567.110,95	7,48%	595.757,41	2.180,85	(698.844,52)
MATD3	1.293.170,55	223.895,27	118.180,06	1,56%	252.245,82	-	(278.112,16)
MULT3	1.490.141,60	208.089,31	127.631,49	1,68%	132.379,88	494,53	(162.751,20)
NTCO3	1.974.659,06	450.085,93	298.518,83	3,94%	454.693,15	1.596,00	(484.634,43)
PETR4	7.313.526,36	1.530.699,98	1.199.265,45	15,81%	1.051.999,86	3.832,96	(1.220.784,93)
PRI03	5.881.511,37	1.439.397,87	1.169.889,86	15,43%	1.604.069,32	5.532,51	(1.643.495,78)
RAIL3	7.032.788,75	1.155.928,13	690.760,31	9,11%	238.938,23	916,12	(312.159,16)
UGPA3	4.234.159,91	761.292,71	694.497,62	9,16%	711.152,52	2.563,66	(805.365,17)
COMPROMISSADA	4.160.391,36	63,04	3,12	0,00%	317,50	(164,17)	(485,45)
Total	78.791.914,18	11.439.209,98	7.583.711,42	100,00%	9.120.241,28	28.790,32	(10.047.161,42)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	99.641.598,93	VAR / PL:	11,498%
VAR:	11.457.052,84	ETL / PL:	14,4193%
ETL:	14.367.611,40	VAR / CDI:	23447,90%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(287,71)	BAIXA 1:	305,56	Cenário 1:	12.935.044,37
				Cenário 2:	43.406,36
				Cenário 3:	(14.578.980,68)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.298,69	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	421.599,92	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	3.151.300,23	256.795,23	137.308,18	1,20%	231.634,27	871,53	(289.557,95)
ALPA4	207.495,26	29.830,04	15.630,00	0,14%	22.401,92	82,95	(26.984,72)
AMER3	423.319,68	167.186,85	111.485,40	0,97%	269.490,62	-	(206.580,39)
ASAI3	602.881,50	91.450,28	67.755,84	0,59%	46.716,42	-	(58.145,07)
AZUL4	218.851,74	84.761,63	63.220,53	0,55%	135.000,31	410,35	(104.935,34)
B3SA3	3.465.390,30	513.841,65	294.910,21	2,57%	254.428,75	957,34	(318.081,92)
Banco BTG Pactual SA UNT	1.530.795,26	204.451,17	172.119,14	1,50%	230.499,57	837,32	(265.651,59)
BBAS3	2.483.348,68	369.364,15	329.167,97	2,87%	359.696,40	1.309,97	(416.980,21)
BBDC3	1.180.529,28	152.854,38	143.780,63	1,25%	152.078,56	557,84	(179.230,03)
BBDC4	4.801.508,80	678.919,43	627.438,84	5,48%	685.172,08	2.497,70	(796.033,71)
BBSE3	904.081,36	80.714,48	51.986,00	0,45%	41.176,75	157,00	(53.095,25)
BEEF3	186.761,88	20.674,21	11.067,38	0,10%	(2.372,25)	(9,31)	3.272,63
BPAN4	110.552,40	22.265,19	13.439,64	0,12%	32.123,08	110,00	(32.384,62)
BRAP4	348.500,24	50.417,61	41.226,29	0,36%	41.009,79	151,19	(48.896,58)
BRFS3	804.594,28	183.740,89	100.050,76	0,87%	103.968,68	381,30	(122.480,45)
BRKM5	534.502,80	90.213,18	71.390,90	0,62%	110.595,76	392,04	(120.540,83)
BRML3	328.804,48	35.446,98	15.650,81	0,14%	41.622,19	152,83	(49.167,26)
CASH3	32.344,48	13.889,44	11.624,05	0,10%	23.421,97	-	(16.916,06)
CCRO3	755.559,52	80.265,04	67.928,73	0,59%	57.901,55	217,54	(72.133,69)
CIEL3	229.018,86	40.688,13	31.796,77	0,28%	4.302,59	16,62	(5.719,90)
CMIG4	795.572,69	122.407,76	110.819,84	0,97%	95.759,05	352,60	(113.853,86)
CMIN3	244.159,44	48.226,84	24.031,55	0,21%	23.477,50	-	(28.637,85)
COGN3	206.687,62	54.261,27	47.009,97	0,41%	54.712,39	189,32	(56.470,71)
CPFE3	306.299,79	62.873,85	37.654,56	0,33%	48.908,46	176,95	(55.850,33)
CPLE6	565.720,95	63.555,96	55.083,11	0,48%	62.808,21	232,25	(75.412,81)
CRFB3	360.591,40	79.484,72	55.521,03	0,48%	70.426,28	250,89	(77.629,31)
CSAN3	1.149.241,59	203.134,88	170.308,71	1,49%	164.173,00	598,43	(190.706,31)
CSNA3	561.165,00	148.583,15	135.191,20	1,18%	174.727,95	593,36	(172.911,42)
CVCB3	85.409,66	31.338,89	18.816,71	0,16%	33.057,83	109,01	(30.655,38)
CYRE3	176.595,40	34.256,94	22.815,32	0,20%	36.910,03	130,72	(40.147,77)
DXCO3	157.302,60	16.445,54	4.641,67	0,04%	16.266,13	-	(19.688,62)
ECOR3	102.988,25	25.032,11	22.080,48	0,19%	20.701,74	73,57	(22.692,69)
EGIE3	561.422,18	54.509,78	44.073,43	0,38%	40.839,73	153,72	(51.094,87)
ELET3	2.380.548,96	235.514,63	136.374,20	1,19%	42.979,68	166,07	(57.186,00)
ELET6	590.300,77	53.385,30	20.689,97	0,18%	(1.432,44)	(5,59)	1.952,13
ENBR3	251.014,26	26.733,79	19.191,44	0,17%	18.554,64	69,80	(23.184,00)
ENEV3	995.310,39	120.786,66	101.330,43	0,88%	57.021,98	216,20	(72.567,30)
ENGI1	533.987,78	58.441,78	26.275,55	0,23%	26.625,33	101,31	(34.166,02)
EQTL3	1.304.996,05	84.413,17	37.395,69	0,33%	29.877,65	115,17	(39.531,77)
EZTC3	77.458,31	12.154,30	9.819,03	0,09%	13.386,32	48,15	(15.086,29)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	99.641.598,93	VAR / PL:	11,498%
VAR:	11.457.052,84	ETL / PL:	14,4193%
ETL:	14.367.611,40	VAR / CDI:	23447,90%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(287,71)	BAIXA 1:	305,56	Cenário 1:	12.935.044,37
				Cenário 2:	43.406,36
				Cenário 3:	(14.578.980,68)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
FLRY3	225.468,36	24.257,66	15.081,23	0,13%	20.522,08	76,59	(25.171,15)
GGBR4	1.341.680,34	324.552,37	299.758,44	2,62%	396.349,29	1.354,55	(397.841,64)
GOAU4	363.135,36	89.156,86	81.936,32	0,72%	105.947,78	362,62	(106.696,16)
GOLL4	84.054,66	32.950,46	26.737,44	0,23%	51.425,97	156,58	(40.116,58)
HAPV3	1.240.637,05	221.086,38	28.255,25	0,25%	173.067,58	631,79	(201.731,07)
HYPE3	805.371,60	101.794,29	92.793,61	0,81%	56.102,69	211,47	(70.428,13)
IGTH1	173.978,34	27.979,84	16.970,86	0,15%	-	-	-
IRBR3	140.655,64	33.281,37	24.425,16	0,21%	21.741,52	78,84	(24.955,75)
ITSA4	2.137.459,52	223.558,84	209.169,11	1,83%	240.488,80	888,67	(288.298,43)
ITUB4	5.832.269,84	740.630,62	712.228,18	6,22%	774.088,65	2.834,44	(908.612,20)
JBSS3	2.218.673,10	173.604,51	113.622,86	0,99%	178.607,22	669,82	(221.573,80)
JHSF3	98.484,48	21.775,87	15.324,19	0,13%	16.825,01	60,58	(18.999,16)
KLBN11	865.105,92	95.197,52	77.773,07	0,68%	108.183,02	397,50	(127.998,09)
LCAM3	400.570,88	46.822,02	39.292,49	0,34%	49.350,19	181,48	(58.502,07)
LREN3	1.152.151,80	196.498,67	173.861,31	1,52%	206.411,43	740,48	(231.165,65)
LWSA3	126.938,24	37.551,24	21.746,19	0,19%	29.038,61	101,99	(30.994,88)
MGLU3	368.954,13	121.532,94	86.224,66	0,75%	195.848,22	613,00	(162.092,86)
MRFG3	228.578,70	33.469,58	17.577,94	0,15%	37.460,94	135,29	(42.597,12)
MRVE3	117.819,57	20.269,80	16.000,82	0,14%	28.380,23	99,18	(29.947,93)
MULT3	323.414,70	44.531,44	22.789,77	0,20%	28.161,71	105,29	(34.688,55)
NTCO3	600.783,14	139.674,62	96.222,63	0,84%	131.735,39	464,54	(141.886,01)
PACUCAR_CBD ON ED	137.639,79	26.431,37	20.808,78	0,18%	31.043,29	109,18	(33.236,10)
PETR3	4.418.217,76	905.477,52	731.218,48	6,38%	732.925,66	2.644,54	(831.744,16)
PETR4	6.774.833,52	1.423.000,70	1.123.566,09	9,81%	1.101.291,93	3.979,49	(1.253.962,29)
PETZ3	184.682,25	30.699,47	5.000,97	0,04%	23.933,85	87,76	(28.184,31)
POSI3	23.357,10	6.262,16	5.452,96	0,05%	8.432,53	28,09	(7.992,97)
PRI03	995.173,83	234.309,61	177.922,90	1,55%	271.008,34	934,88	(277.773,02)
QUAL3	169.828,27	42.680,64	(21.608,85)	-0,19%	(27.720,86)	(117,95)	46.533,04
RADL3	1.087.093,90	179.610,84	44.709,89	0,39%	20.385,72	78,74	(27.102,04)
RAIL3	1.050.988,80	169.577,68	96.356,42	0,84%	30.554,64	117,43	(40.141,87)
RDOR3	1.185.388,41	212.692,16	146.888,07	1,28%	211.644,13	-	(237.168,90)
RENT3	1.629.355,68	218.277,30	183.599,16	1,60%	243.284,42	884,25	(280.746,24)
RRRP3	379.678,40	127.102,60	108.250,47	0,94%	136.663,90	455,36	(129.659,27)
SANB11	560.729,61	84.501,20	66.887,82	0,58%	76.142,04	278,42	(89.091,90)
SBSP3	750.535,68	146.843,30	112.218,28	0,98%	113.892,83	413,51	(131.105,48)
SLCE3	234.911,71	47.471,56	28.672,17	0,25%	37.801,03	136,69	(43.112,42)
SOMA3	239.610,96	41.050,75	29.335,15	0,26%	38.083,97	137,83	(43.521,67)
SULA11	327.656,34	60.570,83	47.732,50	0,42%	53.566,54	193,48	(60.935,56)
SUZB3	1.877.647,45	203.743,25	154.778,97	1,35%	205.665,39	761,02	(247.327,81)
TAE11	445.290,36	39.893,13	15.719,71	0,14%	10.689,05	41,18	(14.124,86)
TIMS3	533.437,50	64.657,16	52.965,50	0,46%	70.687,40	258,86	(82.989,87)
TOTS3	640.157,70	124.500,84	77.519,01	0,68%	93.769,52	341,25	(108.521,49)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	99.641.598,93	VAR / PL:	11,498%
VAR:	11.457.052,84	ETL / PL:	14,4193%
ETL:	14.367.611,40	VAR / CDI:	23447,90%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(287,71)	BAIXA 1:	305,56	Cenário 1:	12.935.044,37
				Cenário 2:	43.406,36
				Cenário 3:	(14.578.980,68)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
UGPA3	720.441,60	126.467,16	114.486,52	1,00%	126.086,97	453,14	(141.789,35)
USIM5	245.423,39	42.058,76	38.836,76	0,34%	70.059,96	240,40	(70.956,20)
VALE3	15.697.095,33	2.507.021,14	2.117.068,69	18,48%	2.091.491,36	7.656,54	(2.453.649,88)
VBBR3	1.012.225,50	119.314,91	99.857,93	0,87%	178.805,87	-	(200.747,77)
VIIA3	176.258,06	60.119,57	56.893,24	0,50%	88.574,63	-	(74.898,45)
VIVT3	1.002.008,70	115.569,70	79.207,10	0,69%	99.983,99	371,63	(121.488,85)
WEGE3	2.043.511,18	285.206,29	(25.427,51)	-0,22%	1.546,41	6,03	(2.099,54)
YDUQ3	212.215,80	51.477,26	43.078,87	0,38%	74.030,24	247,73	(70.905,83)
INDQ22	-	82.073,21	59.144,89	0,52%	-	-	-
COMPROMISSADA	2.656.520,62	41,51	3,97	0,00%	202,78	(104,85)	(310,04)
EMP AÇÃO PROVISÃO	22.993,34	13,79	8,65	0,00%	130,06	(59,10)	(164,24)
LFT	319.650,30	32,04	5,74	0,00%	0,00	0,00	(0,00)
Total	100.738.556,94	15.232.237,65	11.457.052,84	100,00%	12.935.044,37	43.406,36	(14.578.980,68)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/06/2022

FIM EMB V A INVEST NO EXT CNPJ - 41252756000105

Dados Gerais

PL:	48.066.736,40	VAR / PL:	8,979%
VAR:	4.315.863,16	ETL / PL:	11,2599%
ETL:	5.412.268,38	VAR / CDI:	18310,27%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	6.099.991,71	BAIXA 1:	(6.361.232,37)	Cenário 1:	(2.669.853,34)
				Cenário 2:	(465.726,86)
				Cenário 3:	3.977.109,91

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	168.766,42	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	23.518,67	-	-	0,00%	-	-	-
SPY	9.820.896,44	696.915,21	636.762,34	14,75%	(225.459,29)	(85.593,61)	314.890,76
URTH_US	4.010.389,63	450.223,53	420.890,15	9,75%	(370.232,68)	(36.093,51)	564.184,12
VTV_US	6.889.223,14	340.819,57	284.790,10	6,60%	(61.126,15)	(62.003,01)	83.942,25
COMPROMISSADA	292.038,23	4,43	0,42	0,00%	22,29	(11,52)	(34,08)
LFT	11.771,79	15,85	6,06	0,00%	0,00	-	(0,00)
AB AMERICAN GROWTH	5.647.915,62	643.573,30	586.766,69	13,60%	(288.334,44)	(50.831,24)	416.837,58
FUNDSMITH EQ FUND	6.724.974,28	702.333,06	642.464,94	14,89%	(339.472,25)	(60.524,77)	490.416,34
LOOMIS US GROWTH	6.010.898,52	674.809,23	630.843,44	14,62%	(554.916,42)	(54.098,09)	845.616,96
MFS MERIDIAN EUROPEA	4.241.864,15	226.009,57	199.174,50	4,61%	(26.196,83)	(38.176,78)	35.859,95
WELLINGTON GLO QUAL	8.710.481,70	977.876,01	914.164,53	21,18%	(804.137,56)	(78.394,34)	1.225.396,01
Total	52.552.738,59	4.712.579,75	4.315.863,16	100,00%	(2.669.853,34)	(465.726,86)	3.977.109,91



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

30/06/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FI RF EMB II	20/10/14	15/01/23	SABESP	809.345,85	BRBSPPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)	-
FI RF EMB II	21/10/14	15/01/23	SABESP	4.044.308,85	BRBSPPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)	-
FI RF EMB II	24/02/15	15/01/23	SABESP	2.087.495,20	BRBSPPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/05/15	15/04/23	RD COLIN	581.963,68	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	581.606,34	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	639.861,22	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/06/15	15/04/23	RD COLIN	750.360,85	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	12/08/15	16/07/23	DUKE GEP	3.020.474,32	BRGEPADBS079	-	Aaa.br	-	-
FI RF EMB II	06/11/15	04/11/22	BRASESCO	7.822.723,66	BRBBDCLFR744	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB II	18/11/15	16/11/22	BRASESCO	19.410.860,10	BRBBDCLFR8X2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/07/22	ECPT	18.611,92	BRASCPDBS029	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/10/22	ECPT	18.123,19	BRASCPDBS037	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/01/23	ECPT	17.649,33	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	11/02/16	15/01/23	ECPT	61.428,21	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/07/22	ECPT	162.083,58	BRASCPDBS029	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/10/22	ECPT	158.028,83	BRASCPDBS037	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/01/23	ECPT	295.462,54	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/24	TRANS AL	1.833.481,47	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	677.251,68	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	406.351,01	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/24	TRANS AL	1.353.056,57	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	154.872,56	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	99.612,62	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/09/16	15/10/22	ECPT	420.756,23	BRASCPDBS037	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	10/10/16	15/01/23	SABESP	160.575,96	BRBSPPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/07/22	ECPT	310.679,38	BRASCPDBS029	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/10/22	ECPT	305.256,19	BRASCPDBS037	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/01/23	ECPT	143.959,60	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/01/23	ECPT	271.116,17	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/07/22	ECPT	19.883,93	BRASCPDBS029	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/17	15/04/23	RD COLIN	1.381.565,46	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB II	25/08/17	15/08/24	PETR	18.131.152,63	BRPETRDBS084	AAA	Aaa.br	AA(bra)	-
FIM EMB II A	22/09/17	15/09/22	ENERSUL	276.616,35	BRENREDBS024	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/11/27	RB CAPIT	3.974.047,20	BRBRACRIAG2	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/11/27	RB CAPIT	1.159.870,38	BRBRACRIAG2	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	28/01/18	06/11/27	RB CAPIT	4.136.001,49	BRBRACRIAG2	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	29/01/18	27/10/22	SUL AME	663.981,19	BRSLADBS0A0	-	-	A+(bra)	-
FI RF EMB II	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.143.959,21	BRBSPPDBS1A7	brAAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.674.825,58	BRBSPPDBS1A7	brAAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.408.583,42	BRENTVDBS008	brAA	-	-	-
FI RF EMB II	23/05/18	15/05/28	COMGAS	27.515.859,18	BRGASDBS093	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	610.448,00	BRENTVDBS008	brAA	-	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	610.448,00	BRENTVDBS008	brAA	-	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	610.448,00	BRENTVDBS008	brAA	-	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	608.996,90	BRENTVDBS008	brAA	-	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	610.448,00	BRENTVDBS008	brAA	-	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	11.568.954,56	BRERDVDBS0E8	-	A2.br	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	28/07/18	15/07/25	AEGEA SA	14.297.042,93	BRAEGPDBS038	brA	Aa1.br	-	-
FI RF EMB II	26/07/18	15/07/25	CSMG	15.465.714,43	BRCSMGDBS0E7	-	Aa3.br	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	431.872,52	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	245.116,84	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	647.808,78	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/25	CEMIG	1.896.040,27	BRMGEDBS041	brAA+	A1.br	AA-(bra)	-
FIM EMB II A	14/11/18	15/03/24	BRASESCO	307.609,76	BRBBDCLTR6K7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	04/01/19	07/06/24	MOV_PART	773.411,64	BRMOVDBS085	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB II A	17/01/19	16/09/24	ITAUUBB	317.362,44	BRBITALFIU67	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	2.578.921,21	BRBITALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB II A	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	2.578.921,21	BRBITALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	19/08/20	14/08/24	B3SA	1.732.799,88	BRB3SADBS032	-	Aaa.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	538.677,72	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	3.410.762,34	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	1.942.347,57	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	5.872.364,17	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/06/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	700.592,91	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	5.668.433,60	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	8.407.115,00	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	866.187,61	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	589.178,76	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	30/09/20	22/09/25	BCBF	264.297,67	BRBCFBDBS032	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB II A	08/01/21	15/04/24	ECORODOV	1.355.981,54	BRERDVDBS0F5	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB II A	20/01/21	15/07/23	AEGEA SA	600.050,43	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	-	-
FIM EMB II A	20/01/21	23/07/23	COPEL GT	185.687,86	BRCPGTDBS032	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB II A	04/02/21	15/07/23	AEGEA SA	202.833,95	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	-	-
FIM EMB II A	05/02/21	23/07/23	COPEL GT	116.701,11	BRCPGTDBS032	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/23	AEGEA SA	278.896,68	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	-	-
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/24	COPEL GT	299.492,02	BRCPGTDBS057	-	-	AA+(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	22/08/22	ITAU	5.577.103,84	BRBITALFIBU7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	6.060.882,33	BRENTVDBS008	brAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	6.075.629,07	BRENTVDBS008	brAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	4.012.067,88	BRELETDDBS032	brAAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	563.803,69	BRNEOEDBS047	brAA+	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	5.604.490,02	BRNEOEDBS047	brAA+	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	1.661.379,93	BRELETDDBS032	brAAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.184.264,19	BRELETDDBS032	brAAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.406.844,71	BRELETDDBS032	brAAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/07/34	IGUA SAN	2.633.368,23	BRIGSNDBS044	brAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/28	COMGAS	23.965.425,74	BRGASDBS093	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	10.495.417,40	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	877.031,32	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	877.031,32	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	7.016.250,59	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	4.385.156,62	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	6.139.219,27	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	16/07/23	DUKE GEP	12.148.441,81	BRGEPADBS079	-	Aaa.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	690.164,71	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.214.689,89	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.380.329,42	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	690.164,71	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECPT	186.598,50	BRASCPDBS037	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/22	ECPT	149.129,14	BRASCPDBS029	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	844.761,61	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/11/22	ITAU	8.783.474,28	BRBITALFIDR9	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	1.881.562,84	BRERDVDBS052	brAAA	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	627.377,95	BRERDVDBS052	brAAA	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	784.314,42	BRERDVDBS052	brAAA	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	709.498,21	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	2.058.505,46	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	27/01/25	BRADESCO	12.435.008,77	BRBBDCFLRZJ5	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	CCR	5.962.263,77	BRCCRODBS0G5	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	ECORODOV	4.090.315,12	BRERDVDBS0D0	brAAA	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/25	SABESP	1.332.744,38	BRBSBSPDBS1A7	brAAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/28	COMGAS	10.651.300,33	BRGASDBS093	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	JAGUARA	1.829.154,26	BRENGJDBS018	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	ENERGIMIR	1.126.527,76	BRENMDBS018	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	01/08/25	BRADESCO	4.042.277,23	BRBBDCFLRZJ8	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	1.063.253,80	BRBRVLFIS2	-	Aa1.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.197.432,89	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	665.728,74	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	508.634,34	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.362.217,23	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/09/34	BRKA	3.367.102,04	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	2.064.644,78	BRAMERDBS081	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/38	TAUBATE	9.325.107,23	BRLTTEDBS048	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/26	IRB	2.495.712,49	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	984.336,01	BRAMERDBS081	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.824.391,33	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/29	ANET	783.226,62	BRANETDBS002	brA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/28	BRISANET	3.333.273,82	BRBRSTDBS001	brA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/36	PAMPASUL	1.018.118,77	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	-	BRLIGHDBS0D7	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	-	BRLIGHDBS0D7	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	-	BRLIGHDBS0D7	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	-	BRLIGHDBS0D7	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	461.407,50	BRAMERDBS081	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.585.366,87	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/31	LOCALIZA	8.299.732,44	BRRENTDBS0K7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/30	NORTE EN	296.784,41	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.619.280,81	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	15/11/25	QUATA	2.945.796,76	BRQUATDBS019	-	-	A-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	15/12/35	MS 306	2.096.964,45	BRCNRRDBS004	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	29.799,20	BRRLGDBS006	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	427.083,23	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	804.578,40	BRRLGDBS006	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	505.584,02	BRBCFBDBS040	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	505.584,02	BRBCFBDBS040	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	500.995,74	BRNSGODBS0J1	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	1.018.284,03	BRNSGODBS0J1	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	1.003.009,77	BRNSGODBS0J1	-	-	A+(bra)	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/06/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	1.734.583,90	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	433.141,15	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	201.144,60	BRRLGDBS006	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	503.393,63	BRRLGDBS006	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	1.515.711,75	BRBCBFD0S040	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	19/06/24	BNBBM	566.698,89	BRBNBRLF0F8	brAAA	AAbr	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	12/06/24	BNBBM	859.296,59	BRBNBRLF062	brAAA	AAbr	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	483.213,78	BRSBFCDBS002	brA+	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	1.156.990,74	BRSBFCDBS002	brA+	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	01/07/22	CELPA	2.566.253,86	BREQPADBS060	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/12/30	B2W	474.868,61	BRAMERDBS008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/09/34	BRKA	998.436,22	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/10/36	PAMPASUL	2.511.741,42	BRUTPSDBS039	brAAA	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	13/07/23	ECORODOV	2.151.326,49	BRERDVDBS0J7	brAAA	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	15/03/29	OMEGA GE	1.995.269,00	BROMGEDBS069	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/31	CORSAN	779.976,23	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/26	CORSAN	1.060.340,17	BRRSANDBS030	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	15/12/30	MG050	525.776,28	BRRDVIDBS061	brA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/06/21	15/04/28	PAMPASUL	1.199.491,92	BRUTPSDBS005	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAME	301.452,90	BRAMERDBS081	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	1.534.667,32	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAME	1.562.633,41	BRAMERDBS081	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	83.878,58	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.427.082,12	BROVSADBS0E8	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/06/21	15/09/34	BRKA	1.687.964,00	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	15/12/35	MS 306	3.106.614,00	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/10/26	LIGHT	5.402.505,30	BRLIGHDBS055	brA+	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/12/35	MS 306	2.717.251,71	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	1.157.770,55	BRLRENDBS0B4	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	244.852,11	BRLRENDBS0B4	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/03/29	CAGECE	1.198.849,87	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/07/28	VENSJIOR	338.292,77	BRVJSJHDBS001	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/07/28	VENSJIOR	1.632.082,66	BRVJSJHDBS001	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	252.328,93	BRVAMODBS041	brA+	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/03/29	CAGECE	2.732.236,98	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.006.526,35	BRVAMODBS041	brA+	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	31/10/22	ITAU	1.452.199,50	BRBITALFIDB3	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	3.358.908,44	BRBBDCLTRQT4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/07/29	GUARIROB	1.249.007,89	BRGRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	1.960.276,86	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	223.008,14	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	952.134,48	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.709.994,84	BRAMERDBS008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/09/34	BRKA	456.743,20	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	495.109,93	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.508.818,97	BRAMERDBS008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	2.212.934,50	BRAMERDBS008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.106.467,25	BRAMERDBS008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/09/34	BRKA	762.341,91	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	1.876.344,38	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	293.316,13	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	3.920.553,73	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/03/29	ANET	1.106.252,29	BRANETDBS002	brA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	11/03/25	BRML	3.167.931,62	BRBRMLDBS076	brAAA	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	10/05/24	MULTIPLA	3.103.014,63	BRMLTDBS031	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	381.089,94	BRIGHTDBS072	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	381.089,94	BRIGHTDBS072	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	1.358.668,49	BRIGHTDBS072	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/07/27	RT BANDE	2.475.437,90	BRRCRDBS033	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/05/23	ELEKTRO	553.480,90	BREKTRDBS0F0	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/09/23	SONAE	3.113.681,12	BRALSCDBS036	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	15/02/31	CORSAN	2.875.079,06	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	19/07/21	15/07/30	PARANAGU	736.601,19	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/05/30	NORTE EN	1.894.473,84	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/10/30	LAME	1.990.819,58	BRAMERDBS081	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	1.966.934,91	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	720.747,45	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	15/05/25	INTERVIA	1.280.790,62	BRVIADBS074	-	Aa2.br	-	-
FIM EMB I A	21/07/21	05/03/24	ENERG TR	1.327.440,42	BRETENDBS061	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	15/01/26	AERIS	160.069,73	BRAERIDBS006	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	15/07/27	RT BANDE	1.189.998,21	BRRCRDBS033	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/29	OMEGA GE	1.008.608,48	BROMGEDBS069	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	20/08/26	VAMOS	1.070.336,07	BRVAMODBS017	brA+	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	15/12/30	MG050	1.577.328,85	BRRDVIDBS061	brA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/07/21	15/03/29	ANET	2.765.630,74	BRANETDBS002	brA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.514.341,42	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	1.598.792,60	BRMLVDBS050	brA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	4.061.536,53	BRMLVDBS050	brA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/10/24	BKBR	1.415.980,61	BRBKBRDBS048	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/12/26	RD COLIN	2.094.861,12	BRCOLNDBS0C7	brA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/07/21	15/05/30	NORTE EN	1.051.111,46	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/08/21	15/01/31	ECHOENER	1.622.645,96	BRECHPDBS024	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.054.522,87	BRUNEGDBS007	brAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	05/08/21	15/06/32	ENSINOP	689.629,78	BRCSNPDBS022	-	-	AA(bra)	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/06/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FIM EMB VI A CRED PRIV	06/08/21	15/12/31	METRORIO	1.099.512,51	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/08/21	10/08/23	PARANA B	550.546,69	BRPRBCLFCE4	brAA+	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.064.646,70	BRCSANDBS040	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/06/27	AUTOPIST	1.341.551,37	BRAPRBDBS023	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	11/08/21	15/08/31	CSAN	2.927.187,64	BRCSANDBS057	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/08/21	14/08/23	ABC	1.096.510,56	BRABCLF3Q1	brAAA	AA+.br	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/08/21	15/05/30	NORTE EN	3.187.959,24	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	18/08/21	15/12/31	METRORIO	1.115.049,10	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	15/12/31	METRORIO	865.268,54	BRMGPRDBS068	brAAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/08/21	15/08/29	CEEE D	4.065.914,42	BRCEEDDBS019	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.049.050,02	BRRDORDBS0A0	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/09/21	15/08/31	COMGAS	3.351.051,38	BRCGASDBS0B7	-	AAA(bra)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/09/21	15/05/30	NORTE EN	518.136,12	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	689.220,21	BRGRRDBS034	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	61.721,21	BRGRRDBS034	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	308.606,06	BRGRRDBS034	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/06/24	PROLAGOS	2.194.636,50	BRPRLGDBS037	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/04/26	ELETROB	2.018.652,41	BRELETDDBS040	brAAA	-	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	21/10/26	AUTOBAN	818.129,44	BRANHBDBS0F3	brAAA	-	-	-
FIM EMB I A	17/09/21	01/10/24	EQUATENE	1.442.405,10	BREQTLDBS036	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	17/09/21	15/03/28	BRISANET	1.461.672,99	BRBRSTDBS001	brA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.074.987,54	BRMOVIDBS0G1	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/12/30	MG050	1.051.552,57	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/12/30	MG050	1.051.552,57	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.062.733,84	BRMOVIDBS0H9	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/07/30	EDPM	2.098.888,64	BRMGSPDBS017	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	801.642,24	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	801.642,24	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	266.491,88	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	266.491,88	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	721.930,81	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	721.930,81	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	927.687,04	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	360.370,73	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	360.370,73	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.136.469,79	BRLCAMDBS0R2	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.192.013,98	BRLCAMDBS0R2	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	23/09/21	14/08/23	ABC	1.096.510,56	BRABCLF3Q1	brAAA	AA+.br	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	15/03/24	CCPR	41.023,20	BRCCPRDBS0D1	-	A.br	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	20/05/25	CEA MODA	1.640.785,31	BRCEABDBS011	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.090.702,36	BRBPANLF654	brAAA	AAAbr	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	15/01/26	LOCAMERI	1.932.568,97	BRLCAMDBS0O9	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	05/03/24	ENERG TR	2.078.326,41	BRETENDBS061	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	10/08/23	PARANA B	1.101.093,37	BRPRBCLFCE4	brAA+	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	01/04/24	CNH	2.026.858,21	BRCNHCLF317	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	821.311,39	BRSMHDBS044	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	874.882,57	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	1.988.369,48	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/10/21	15/12/31	METRORIO	590.390,41	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.217.956,32	BRTCIDBS009	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.238.452,54	BRDAYCLFNKX1	brAA+	AA.br	AA(bra)	-
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.250.578,11	BRDAYCLFNKW3	brAA+	AA.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	15/12/35	CART	2.671.161,44	BRPPTADB033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	22/10/21	15/12/35	CART	1.602.696,86	BRPPTADB033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/10/21	15/03/26	VIX LOGI	1.031.522,63	BRVXLDBS047	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB I A	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.223.280,54	BRCGBPDBS014	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	831.837,15	BRHARGDBS003	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	6.610.626,33	BRHARGDBS003	brAAA	-	-	-
FIM EMB I A	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.369.806,01	BRBTOYLF2F4	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/10/21	15/10/31	ENERGISA	3.014.359,47	BRENGIDBS0Q0	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/10/21	15/10/31	CELP	2.122.811,70	BRCEPEDBS0G7	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/10/21	15/10/31	COELBA	2.116.983,03	BRCEEBDBS0I9	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	03/11/21	15/06/32	ENSINOP	1.524.081,82	BRCSNPDBS022	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/11/21	15/07/39	UTE GNA	3.155.265,29	BRUNEGDBS007	brAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/11/21	15/10/28	LIGHT	1.531.334,18	BRLIGHDBS0Z0	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.109.069,33	BRVAMODBS074	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	4.001.848,05	BRHBSADBS010	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	15/06/39	ANEMUS	5.528.511,08	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	15/07/29	GUARIROB	2.130.004,52	BRGRRDBS042	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	15/04/26	ECORODOV	2.055.183,59	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	15/06/39	ANEMUS	2.266.852,62	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	15/03/28	BRISANET	833.043,70	BRBRSTDBS001	brA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	03/12/21	11/06/24	BNNBM	567.192,47	BRBNBRLF005	brAAA	AAbr	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	15/12/35	TESC	8.964.329,53	BRCEJENDBS009	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	15/11/25	QUATA	2.448.083,32	BRQUATDBS019	-	-	A-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	15/07/39	EDPM	3.649.381,14	BRMGSPDBS017	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	15/03/29	ANET	1.027.708,38	BRANETDBS002	brA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	20/12/21	15/11/35	HAZTEC	2.120.684,79	BRHZTCDBS013	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/01/22	15/09/41	TUCANOHO	1.656.974,56	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/01/22	15/09/41	TUCANOHO	328.080,96	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/01/22	15/03/26	VIX LOGI	1.012.556,95	BRVXLDBS047	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/01/22	15/07/30	PARANAGU	1.491.590,36	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB I A	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.059.787,24	BRINTLLF6T5	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	15/07/34	RT BANDE	353.986,61	BRCRBDBS041	-	-	AAA(bra)	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/06/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	15/07/34	RT BANDE	5.917.697,09	BRCRBDBS082	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	15/12/35	CART	341.908,66	BRRPTADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	15/12/35	CART	331.224,02	BRRPTADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.568.674,97	BRPILDBS008	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/02/22	15/10/36	HOLDARAG	2.203.542,11	BRHARGDBS003	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	15/12/35	CART	790.663,79	BRRPTADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	15/12/35	CART	705.186,62	BRRPTADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.101.097,72	BRGBSPDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/03/22	15/03/44	GBS PART	3.578.511,93	BRGBSPDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	15/06/39	ANEMUS	1.040.236,07	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	830.301,84	BRUGELDBS001	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	19/04/22	16/04/29	VERT-10	1.761.841,03	BRVCCSDBS007	-	-	AAAsf(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	26/04/22	15/04/24	LIGHT	2.051.260,04	BRLIGHDBS108	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	15/10/36	UHESIMAO	1.509.641,99	BRUHSMDBS023	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	15/07/30	PARANAGU	3.089.182,07	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	15/07/30	PARANAGU	1.524.039,75	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/05/22	15/04/27	BRKA	2.245.811,78	BRBRKPDBS071	-	A+.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	15/07/30	PARANAGU	1.828.900,74	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	15/10/36	UHESIMAO	3.027.411,26	BRUHSMDBS023	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	15/09/41	TUCANOHO	1.831.509,22	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	508.196,91	BRCEABDBS037	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.496.640,63	BRGUARDBS071	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	15/10/36	HOLDARAG	2.399.657,36	BRHARGDBS003	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	15/12/35	IP SUL C	495.649,30	BRPILDBS008	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	15/07/30	PARANAGU	1.405.058,65	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	15/09/41	AESTUCAN	2.781.170,72	BRTCIDBS009	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	15/06/25	ECORODOV	5.901.741,06	BRERDVDBS0E8	-	A2.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	15/06/25	ECORODOV	983.192,29	BRERDVDBS0E8	-	A2.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	15/12/36	VIA BRAS	3.314.904,89	BRVIMTDBS019	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	15/12/36	VIA BRAS	2.610.986,84	BRVIMTDBS019	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	15/03/29	ANET	521.044,83	BRANETDBS002	brA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	15/12/35	TESC	785.188,86	BRJCJENDBS009	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	15/03/28	BRISANET	496.749,02	BRBRSTDBS001	brA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/22	12/05/32	BRASKEM	503.224,70	BRBRKMDBS0B9	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	15/12/35	IP SUL C	396.519,44	BRPILDBS008	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	15/12/35	TESC	492.498,10	BRJCJENDBS009	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	15/06/39	ANEMUS	265.592,19	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/09/31	SIMPAR	1.767.980,83	BRSIMHDBS044	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/06/31	VAMOS	859.119,92	BRVAMODBS041	brAA+	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/06/31	VAMOS	70.091,37	BRVAMODBS041	brAA+	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/03/29	OMEGA GE	839.010,61	BROMGEDBS069	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/03/29	OMEGA GE	948.750,41	BROMGEDBS069	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/22	15/04/31	BRDESCO	3.175.165,36	BRBBDCLTRNA1	brAAA	Aaa.br	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/06/22	15/04/28	PAMPASUL	2.649.352,16	BRUTPSDBS005	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	21/06/22	15/07/34	RT BANDE	1.292.051,14	BRCRBDBS041	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.003.076,37	BRLAGELF008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	FIDC VERDECARD SN3	3.702.447,30	BRVDCRCTF024	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	SANEAGOIFR IV 1 FIDC	799.194,96	BRSNGSCTF002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	FIDC CELG DIST SN B	2.370.675,33	BRFCGLCTF015	-	-	AA-sf(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	FIDC CREDZ SN4	13.902,63	BRCRDZCTF074	-	-	AAAsf(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.515.626,16	BRCRDZCTF0A0	brAA (sf)	-	A+s(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	FIDC VERDECARD SN5	671.211,12	BRVDCRCTF040	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	FIDC VERDECARD SN6	1.400.815,64	BRVDCRCTF057	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	756.676,00	BR08ILCTF045	brAA-(sf)	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	FARM SYN AGRO FIDC	3.443.945,71	BR032XCTF002	-	-	AAAsf(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	BR ELETRO FIDC S1	4.229.056,77	BR0402CTF000	-	-	AAsf(bra)	-

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

4. RISCO OPERACIONAL

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



5. RISCO DE LIQUIDEZ

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

6. RISCO LEGAL

Para acompanhamento do risco legal, a Entidade controlará diariamente seus investimentos, através dos relatórios elaborados pelo administrador dos fundos e/ou carteiras da EMBRAER PREV, para que estes estejam enquadrados às determinações legais e aos limites estabelecidos na Política de Investimento dos Planos sob sua administração. Os seguintes relatórios elaborados pelo administrador são utilizados pela EMBRAER PREV para o controle do risco legal:

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **4.004.442.661,67**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.311.952.866,12	4.004.442.661,67	82,71%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BAC	100,00%	2.504.062.541,38	4.004.442.661,67	62,53%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	807.890.324,74	3.203.554.177,07	20,17%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	800.888.544,27	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	400.444.272,13	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.001.110.665,42	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.001.110.665,42	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	453.004.130,05	2.803.109.815,43	11,31%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.001.110.665,42	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	99.157.759,40	800.888.544,27	2,48%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	30.132.019,30	600.666.423,12	0,75%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	800.888.544,27	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	87.708.280,87	400.444.272,13	2,19%	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 2022 À 30 DE JUNHO DE 2022



Bradesco

FIM EMB I A

FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
15/06/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,9495%	5,8636%	5,6887%	6,0763%	0,0859%	NÃO
28/06/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,9695%	6,0585%	5,8165%	6,1128%	-0,0890%	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
23/06/2022	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,9024%	6,9800%	6,7012%	7,5455%	-0,0776%	NÃO
23/06/2022	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,9024%	6,9800%	6,7012%	7,5455%	-0,0776%	NÃO
23/06/2022	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,9024%	6,9800%	6,7012%	7,5455%	-0,0776%	NÃO
23/06/2022	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2023	Venda	7,0711%	6,9800%	6,7012%	7,5455%	0,0911%	NÃO
23/06/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,9785%	6,9800%	6,7012%	7,5455%	-0,0015%	NÃO
23/06/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,9785%	6,9800%	6,7012%	7,5455%	-0,0015%	NÃO
23/06/2022	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2023	Venda	7,0611%	6,9800%	6,7012%	7,5455%	0,0811%	NÃO
23/06/2022	FIM EMB II A	BNP	TULL PRE	NTN-B	15/05/2023	Venda	7,0010%	6,9800%	6,7012%	7,5455%	0,0210%	NÃO
23/06/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,9785%	6,9800%	6,7012%	7,5455%	-0,0015%	NÃO
23/06/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,6490%	5,5279%	5,3344%	5,8603%	0,1211%	NÃO
23/06/2022	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,6090%	5,5279%	5,3344%	5,8603%	0,0811%	NÃO
23/06/2022	FIM EMB II A	BNP	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,5890%	5,5279%	5,3344%	5,8603%	0,0611%	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
15/06/2022	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	ATIVA	NTN-B	15/05/2025	Venda	5,8910%	5,6522%	5,3801%	6,1755%	0,2388%	NÃO
28/06/2022	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Venda	5,7310%	5,9331%	5,4883%	6,0591%	-0,2021%	NÃO
29/06/2022	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	N FUTURA	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,0490%	6,0722%	5,8826%	6,1797%	-0,0232%	NÃO

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL Mês de Referência: 01 DE JUNHO DE 2022 À 30 DE JUNHO DE 2022



Bradesco

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
01-06-22	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,73	12.800,00	175.719,94	13,61	13,73	13,97	12.040,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,72	5.900,00	80.942,04	13,61	13,73	13,97	12.040,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,80	2.500,00	34.500,00	13,61	13,73	13,97	12.040,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,75	3.400,00	46.736,68	13,61	13,73	13,97	12.040,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Compra	BIDI11	12,17	4.200,00	51.095,89	12,00	12,28	12,84	23.747,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Venda	HBSA3	3,10	7.361,00	22.829,28	3,07	3,10	3,17	6.503,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	40,70	900,00	36.630,00	40,11	41,33	42,02	50.432,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	41,10	15.200,00	624.784,32	40,11	41,33	42,02	50.432,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	41,87	700,00	29.309,20	40,11	41,33	42,02	50.432,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,30	3.500,00	67.557,73	19,07	19,32	19,87	23.862,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	6,53	300,00	1.957,69	6,45	6,53	6,74	737,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	3,73	200,00	746,91	3,67	3,72	3,81	746,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	28,35	2.800,00	79.366,48	27,64	28,31	28,64	34.664,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,83	6.700,00	119.456,10	17,62	17,81	18,16	29.335,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	19,16	900,00	17.244,00	19,10	19,22	19,50	32.678,00
01-06-22	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	19,19	1.700,00	32.627,24	19,10	19,22	19,50	32.678,00
01-06-22	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAN4	7,80	9.422,00	73.512,17	7,73	7,84	8,10	8.020,00
01-06-22	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	4,62	11.057,00	51.045,38	4,56	4,61	4,75	10.371,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	14,12	6.240,00	88.108,80	14,05	14,15	14,24	24.842,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALPA4	21,16	290,00	6.136,40	20,89	21,26	21,94	18.959,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AMER3	19,34	850,00	16.439,00	19,30	19,59	20,21	21.257,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASAI3	15,42	1.130,00	17.424,60	15,29	15,59	16,13	17.410,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	18,94	470,00	8.901,80	18,80	19,19	20,33	27.807,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	B3SA3	12,50	8.530,00	106.625,00	12,49	12,58	12,83	32.823,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBAS3	36,69	2.020,00	74.113,80	36,05	36,47	37,00	31.870,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC3	16,60	2.160,00	35.856,00	16,60	16,69	16,85	12.469,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	20,13	7.350,00	147.955,50	20,01	20,16	20,53	50.048,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSF3	26,72	960,00	25.651,20	26,48	26,70	26,91	14.839,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	14,14	370,00	5.231,80	13,84	14,07	14,19	12.791,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BIDI11	12,00	820,00	9.840,00	12,00	12,28	12,84	23.747,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	24,84	1.850,00	45.954,00	24,77	24,95	25,50	24.885,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAN4	7,75	490,00	3.797,50	7,73	7,84	8,10	8.020,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	29,21	360,00	10.515,60	28,33	29,16	29,44	14.967,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	15,34	1.530,00	23.470,20	15,13	15,30	15,49	24.990,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	45,58	380,00	17.320,40	43,82	45,24	46,20	18.472,00
01-06-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRML3	8,29	1.180,00	9.782,20	8,27	8,37	8,50	23.564,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL Mês de Referência: 01 DE JUNHO DE 2022 À 30 DE JUNHO DE 2022

Table with columns: DATA, FUNDO, TIPO OPERAÇÃO, PAPEL, PREÇO, QT OPERADA, FINANCEIRO R\$, DADOS BM&FBOVESPA (PREÇO MÍNIMO, PREÇO MÉDIO, PREÇO MÁXIMO), VOLUME TOTAL NEG. BOLSA. Contains daily transaction records for various funds.



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE JUNHO DE 2022 À 30 DE JUNHO DE 2022



Bradesco

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
30-06-22	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	8,39	10.200,00	85.598,62	8,31	8,40	8,51	34.281,00
30-06-22	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	8,47	15.900,00	134.673,00	8,31	8,40	8,51	34.281,00
30-06-22	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	22,71	9.000,00	204.390,00	22,53	22,71	22,88	47.223,00
30-06-22	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	22,72	8.500,00	193.080,37	22,53	22,71	22,88	47.223,00
30-06-22	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	22,22	3.300,00	73.323,43	21,77	22,43	22,79	40.678,00
30-06-22	FIA RVA EMB III	Venda	MEGA3	12,75	82.854,00	1.056.388,50	11,85	12,70	12,78	13.955,00
30-06-22	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	16,59	4.100,00	68.020,84	16,34	16,73	16,89	23.189,00
30-06-22	FIA RVA EMB IV	Compra	ENEV3	14,56	23.162,00	337.332,86	14,43	14,72	14,93	28.073,00
30-06-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	MALL11	100,95	903,00	91.159,53	100,30	100,94	101,35	1.878,00

7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

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

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

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



8. GLOSSÁRIO

Administrador

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

Carteira

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

Dados Gerais

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

Duration

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

Vide também glossário de Valor Presente.

ETL (Expected Tail Loss)

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

Fundo de Investimento

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

Índice de Referência (Benchmark)

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



LDI (Liability Driven Investments)

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

Parâmetros do Cálculo do VaR (Value at Risk)

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

Patrimônio de Cobertura

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

Patrimônio Líquido (PL)

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

Rating

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

Stress Testing

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

Tracking Error

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



Túnel de Preços

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

Valor Presente

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

Value at Risk (VaR)

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