



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Outubro/2021





1. INTRODUÇÃO

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

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

2. RISCO DE MERCADO

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

2.1 Relatório Detalhado de Risco



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.653.621.890,68	VAR / PL:	2,645%
VAR:	96.641.011,90	ETL / PL:	3,3170%
ETL:	121.191.769,33	VAR / CDI:	9041,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(150.079.743,37)	BAIXA 1:	256.617.250,22	Cenário 1:	474.936.158,29
				Cenário 2:	(70.934.631,85)
				Cenário 3:	65.535,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	207.569,37	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	2.130.183,89	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	24.818.204,00	1.870.050,53	(708.266,49)	-0,73%	4.449.953,24	15.962,66	(4.982.885,64)
AIEC11	943.433,75	64.338,05	44.442,44	0,05%	69.273,80	-	(86.604,07)
ALPA4	371.131,67	101.105,90	63.017,72	0,07%	199.868,22	623,90	(164.466,57)
ALSO3	1.448.566,00	133.339,88	106.683,22	0,11%	451.711,56	1.533,68	(446.830,70)
AMER3	4.007.919,36	977.550,14	(395.794,90)	-0,41%	-	-	-
ASAI3	5.673.406,70	1.178.675,80	962.102,77	1,00%	-	-	-
AZUL4	439.412,94	98.195,94	84.512,67	0,09%	140.298,54	474,95	(137.873,43)
B3SA3	26.087.212,48	1.990.450,93	790.304,43	0,82%	6.329.882,15	22.103,83	(6.668.499,74)
Banco BTG Pactual SA UNT	19.063.627,12	1.877.097,64	1.499.717,74	1,55%	6.601.763,72	22.113,45	(6.336.975,99)
BBAS3	15.055.836,53	1.439.908,14	11.760,13	0,01%	(147.979,63)	(579,76)	203.446,41
BBDC3	1.236.879,00	127.554,52	(57.554,41)	-0,06%	158.717,60	582,32	(187.151,70)
BBDC4	33.283.197,87	3.968.092,25	(2.084.048,25)	-2,16%	3.301.161,26	12.273,39	(4.013.750,78)
BBRK3	19.321,00	3.341,62	1.651,38	0,00%	13.148,94	39,14	(9.778,48)
BBSB3	1.258.435,71	224.792,63	(128.712,33)	-0,13%	(196.776,91)	(833,96)	327.115,89
BEEF3	114.252,21	28.439,39	15.467,02	0,02%	(29.199,93)	(131,39)	56.374,27
BIDI11	5.568.776,46	1.603.054,84	1.103.205,76	1,14%	7.202.863,38	18.050,23	(3.766.196,42)
BIDI3	938,96	-	-	0,00%	-	-	-
BIDI4	139.337,92	35.293,38	26.361,03	0,03%	155.881,70	408,46	(89.107,69)
BLCP11	1.526.877,30	-	-	0,00%	-	-	-
BMGB4	140.874,00	13.569,22	8.799,64	0,01%	33.089,65	115,92	(35.114,81)
BMLC11	1.756.924,80	-	-	0,00%	-	-	-
BPAN4	3.401.630,40	373.622,09	177.783,44	0,18%	1.449.433,74	4.710,44	(1.301.660,83)
BPML11	1.271.855,72	72.162,91	22.593,53	0,02%	98.755,88	370,85	(122.894,18)
BRAP4	2.177.960,42	222.780,48	(31.303,65)	-0,03%	266.877,62	981,71	(316.588,72)
BRFS3	952.383,25	166.647,98	89.557,71	0,09%	(61.894,00)	(249,47)	91.059,42
BRIT3	194.922,00	33.497,97	19.900,49	0,02%	-	-	-
BRKM5	769.818,06	144.287,79	17.871,23	0,02%	164.301,75	580,81	(177.955,46)
BRML3	6.410.387,76	672.243,79	534.540,23	0,55%	2.061.730,19	6.973,05	(2.021.937,42)
CASH3	272.358,87	147.375,62	116.014,36	0,12%	242.126,38	-	(157.604,04)
CBAV3	258.013,00	33.835,54	21.114,26	0,02%	-	-	-
CBOP11	31.237,08	1.530,80	(757,66)	0,00%	3.143,80	11,68	(3.816,48)
CCRO3	661.319,00	70.107,77	4.101,00	0,00%	37.159,76	140,96	(47.348,16)
CEOC11	884.169,20	39.392,70	(25.437,25)	-0,03%	62.686,30	236,15	(78.585,97)
CESP6	11.652.710,40	681.843,68	(331.772,70)	-0,34%	(169.667,53)	(666,32)	234.586,08
CIEL3	2.926.413,00	530.123,02	(209.000,84)	-0,22%	642.690,96	2.266,00	(691.984,37)
CLSA3	1.795.390,00	142.772,66	32.736,06	0,03%	-	-	-
CMIG4	744.448,32	91.758,21	69.849,80	0,07%	(9.227,58)	(36,20)	12.725,25
CNES11	565.910,40	27.890,13	(1.938,30)	0,00%	17.729,03	68,06	(23.231,95)
CNRD11	78.302,00	-	-	0,00%	-	-	-



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.653.621.890,68	VAR / PL:	2,645%
VAR:	96.641.011,90	ETL / PL:	3,3170%
ETL:	121.191.769,33	VAR / CDI:	9041,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(150.079.743,37)	BAIXA 1:	256.617.250,22	Cenário 1:	474.936.158,29
				Cenário 2:	(70.934.631,85)
				Cenário 3:	65.535,00

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
COGN3	241.637,82	31.894,69	4.713,32	0,00%	69.485,06	238,22	(70.241,06)
CPFE3	7.304.916,32	860.929,21	389.091,55	0,40%	906.944,47	3.333,75	(1.074.064,88)
CPL66	484.273,78	58.108,10	45.207,39	0,05%	8.260,21	31,93	(11.003,20)
CRFB3	1.926.043,00	101.629,74	13.567,54	0,01%	182.316,27	679,25	(222.746,41)
CSAN3	1.750.508,38	220.381,14	176.959,31	0,18%	83.374,05	317,57	(107.255,04)
CSED3	2.547.144,00	393.609,13	32.087,35	0,03%	-	-	-
CSNA3	795.844,20	99.795,58	9.135,63	0,01%	455.362,17	1.405,10	(365.512,63)
CURY3	66.528,00	7.892,99	4.430,60	0,00%	15.438,93	54,15	(16.427,54)
CVCB3	191.962,89	48.787,99	40.697,39	0,04%	53.182,31	183,11	(54.275,59)
CYRE3	993.283,20	174.529,39	160.249,56	0,17%	425.303,24	1.381,11	(381.300,67)
DXCO3	227.263,77	23.503,51	2.281,89	0,00%	-	-	-
ECOR3	144.574,78	16.446,80	9.730,19	0,01%	39.690,53	136,79	(40.599,26)
EGIE3	5.263.569,58	267.471,76	(57.647,60)	-0,06%	181.495,82	695,71	(236.977,25)
ELET3	2.986.003,02	306.289,92	122.748,03	0,13%	140.834,87	536,56	(181.268,80)
ELET6	7.699.525,65	787.712,43	460.445,57	0,48%	504.769,03	1.906,34	(636.525,21)
ENAT3	2.231.746,00	554.142,68	(134.050,99)	-0,14%	(362.720,98)	(1.542,71)	608.266,64
ENBR3	237.200,53	15.230,38	(7.935,18)	-0,01%	(7.780,43)	(30,84)	10.997,43
ENEV3	3.881.495,07	469.552,29	386.812,19	0,40%	637.640,54	2.302,36	(724.781,64)
ENGI11	505.455,04	38.524,32	17.602,46	0,02%	26.420,70	100,41	(33.812,15)
EQTL3	12.550.971,44	1.082.070,97	811.625,64	0,84%	1.277.044,53	4.742,33	(1.548.469,96)
ESPA3	1.512.771,41	646.403,10	458.350,46	0,47%	-	-	-
EUCATEX PN	77.988,00	7.784,65	2.947,98	0,00%	18.580,84	65,00	(19.655,65)
EWJ_US	4.425.015,96	194.795,11	(100.466,20)	-0,10%	(499.275,97)	(39.825,14)	781.755,22
EZTC3	99.084,96	15.578,76	13.547,92	0,01%	48.070,48	152,90	(41.196,55)
FLRY3	286.287,40	39.272,49	27.911,48	0,03%	98.206,55	329,37	(94.533,34)
GALG11	1.264.200,00	35.996,73	14.468,32	0,01%	35.025,59	-	(46.087,74)
GALG12	1.148,26	4.419,13	3.877,17	0,00%	-	-	-
GETT11	18.297,75	142.340,84	(3.571,97)	0,00%	-	-	-
GGBR4	10.216.309,20	1.356.309,85	(720.754,39)	-0,75%	(241.694,10)	(953,56)	337.851,42
GGPS3	2.637.326,86	455.400,29	311.136,47	0,32%	-	-	-
GMAT3	4.699.669,69	882.354,85	(220.928,98)	-0,23%	(764.274,09)	(3.250,75)	1.281.826,39
GNDI3	13.196.559,04	2.230.619,25	1.299.808,64	1,34%	5.154.406,91	16.974,93	(4.765.758,91)
GOAU4	457.172,49	59.103,73	(33.574,86)	-0,03%	(22.846,70)	(91,36)	32.984,55
GOLL4	135.962,12	30.715,42	25.856,80	0,03%	21.082,94	76,43	(24.187,75)
HAPV3	17.633.509,59	3.566.766,39	2.146.824,56	2,22%	7.983.907,21	25.693,73	(7.018.264,95)
HBRH11	2.385.752,80	-	-	0,00%	-	-	-
HBSA3	285.376,71	32.295,86	15.026,01	0,02%	136.375,64	434,92	(117.536,39)
HSML11	7.206.348,30	274.304,89	34.255,85	0,04%	281.412,37	1.076,33	(365.536,43)
HYPE3	2.767.912,52	349.169,65	178.139,11	0,18%	887.097,09	3.001,62	(870.839,18)
IFCM3	3.585.300,00	511.970,07	222.454,16	0,23%	-	-	-



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.653.621.890,68	VAR / PL:	2,645%
VAR:	96.641.011,90	ETL / PL:	3,3170%
ETL:	121.191.769,33	VAR / CDI:	9041,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(150.079.743,37)	BAIXA 1:	256.617.250,22	Cenário 1:	474.936.158,29
				Cenário 2:	(70.934.631,85)
				Cenário 3:	65.535,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
IGTA3	672.444,39	71.411,67	14.535,16	0,02%	111.308,32	401,69	(126.361,24)
INTB3	5.446.910,84	883.438,15	764.267,70	0,79%	-	-	-
IRBR3	308.556,99	25.763,40	(9.939,48)	-0,01%	35.755,74	131,92	(42.712,43)
ITSA4	16.127.024,76	807.159,37	394.953,70	0,41%	835.444,47	3.175,86	(1.069.726,62)
ITUB4	35.667.484,93	5.457.108,84	2.735.647,64	2,83%	14.677.474,63	47.958,85	(13.338.564,43)
JBSS3	19.450.320,96	1.879.297,56	128.793,51	0,13%	(5.247.486,48)	(23.828,04)	10.368.247,65
JHSF3	80.814,65	7.437,85	4.864,39	0,01%	21.809,70	75,31	(22.404,23)
JRDM11	1.096.364,70	26.394,59	4.546,14	0,00%	17.954,27	69,43	(23.935,29)
KLBN11	989.477,20	93.935,87	(40.383,02)	-0,04%	152.656,44	553,63	(175.276,89)
LAME4	4.904.231,23	3.082.334,92	(1.322.785,27)	-1,37%	1.742.912,60	5.817,60	(1.660.019,98)
LCAM3	576.679,50	87.720,59	78.980,80	0,08%	152.064,41	526,42	(157.098,85)
LJQQ3	156.000,00	29.700,54	24.835,70	0,03%	115.310,93	336,94	(82.460,08)
LREN3	14.597.646,35	917.222,73	508.821,11	0,53%	3.377.875,66	11.850,91	(3.596.443,34)
LVB11	3.795.863,70	123.023,71	87.404,68	0,09%	119.093,60	457,20	(156.050,88)
LWSA3	4.974.120,00	482.276,45	351.068,89	0,36%	1.368.404,28	4.715,13	(1.399.004,50)
MALL11	7.281.222,68	254.220,74	99.348,21	0,10%	162.761,03	627,59	(215.486,99)
MATD3	1.989.816,12	111.261,75	49.175,72	0,05%	-	-	-
MAXR11	1.467.590,00	53.085,52	20.890,92	0,02%	19.671,79	76,19	(26.315,60)
MDNE3	53.560,00	9.435,91	8.411,14	0,01%	31.822,90	97,47	(25.140,11)
MGLU3	6.901.247,90	1.202.311,35	714.300,61	0,74%	5.887.828,21	16.617,74	(3.916.807,42)
MOVI3	7.813.948,00	1.041.581,04	882.472,94	0,91%	2.267.189,53	7.764,71	(2.286.517,78)
MRFG3	453.509,00	70.041,60	14.139,28	0,01%	(163.108,39)	(787,44)	377.590,38
MRVE3	376.438,72	62.058,54	52.363,01	0,05%	162.847,04	527,96	(145.478,78)
MULT3	2.258.299,47	190.401,42	91.604,33	0,09%	503.891,90	1.774,00	(540.724,86)
NEWU11	600.237,00	-	-	0,00%	-	-	-
NTCO3	22.359.164,58	2.233.166,74	1.445.880,92	1,50%	9.013.517,30	29.544,32	(8.247.869,32)
OMGE3	3.709.758,06	319.335,97	68.449,80	0,07%	512.060,04	1.870,53	(597.768,92)
ONCO3	183.600,00	54.399,03	36.002,44	0,04%	-	-	-
PACUCAR_CBD ON ED	208.225,29	36.009,39	(14.668,02)	-0,02%	37.095,95	133,14	(41.585,93)
PARD3	600.955,95	110.932,03	41.008,60	0,04%	143.116,04	500,69	(151.409,64)
PATC11	8.028.146,63	245.257,17	(45.543,88)	-0,05%	32.875,68	127,91	(44.459,94)
PETR3	31.154.896,74	3.883.568,21	(1.414.690,81)	-1,46%	(3.940.935,49)	(16.422,38)	6.285.516,88
PETR4	37.143.922,24	4.789.178,62	(1.779.620,96)	-1,84%	(5.028.889,93)	(21.060,59)	8.118.957,03
PETZ3	3.726.134,62	1.016.638,45	713.597,91	0,74%	2.011.585,36	6.276,41	(1.653.651,15)
POWE3	73.750,00	10.458,57	6.688,51	0,01%	-	-	-
PRIO3	13.666.457,04	4.072.585,37	(615.383,81)	-0,64%	(6.243.432,98)	(32.481,70)	17.656.746,19
PVBI11	2.283.307,00	139.629,83	(71.524,00)	-0,07%	177.142,09	-	(220.455,63)
QAGR11	8.228.908,57	293.531,71	(32.927,44)	-0,03%	(112.045,37)	-	154.741,36
QUAL3	457.622,40	70.225,96	31.427,21	0,03%	176.096,90	581,21	(163.605,01)
RADL3	7.501.430,94	1.088.936,37	509.975,09	0,53%	2.378.943,99	8.060,19	(2.342.259,30)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.653.621.890,68	VAR / PL:	2,645%
VAR:	96.641.011,90	ETL / PL:	3,3170%
ETL:	121.191.769,33	VAR / CDI:	9041,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(150.079.743,37)	BAIXA 1:	256.617.250,22	Cenário 1:	474.936.158,29
				Cenário 2:	(70.934.631,85)
				Cenário 3:	65.535,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
RAIL3	9.447.544,40	716.540,71	380.839,66	0,39%	1.845.079,26	6.573,05	(2.033.810,28)
RAIZ4	360.696,00	28.117,77	22.049,55	0,02%	-	-	-
RAPT4	4.310.250,00	475.989,45	289.025,70	0,30%	436.338,17	1.620,73	(529.369,01)
RBGS11	523.907,28	55.506,44	49.131,42	0,05%	95.879,72	343,38	(106.969,66)
RBRL11	1.858.964,02	141.548,98	106.302,60	0,11%	-	-	-
RRCRB11	1.661.717,40	84.691,77	24.306,09	0,03%	(68.561,59)	(272,95)	97.921,46
RDOR3	1.298.528,00	151.648,06	89.137,53	0,09%	208.092,48	-	-
RECV3	862.125,00	230.173,76	165.004,77	0,17%	-	-	-
RENT3	5.875.075,10	829.534,39	743.261,29	0,77%	1.400.145,02	4.898,08	(1.481.043,80)
RNGO11	152.498,84	7.720,71	2.014,96	0,00%	(3.594,77)	(14,18)	5.024,42
SANB11	551.844,40	52.546,13	(18.606,09)	-0,02%	85.365,43	309,54	(97.973,96)
SBSP3	633.219,72	66.315,91	32.389,71	0,03%	(28.310,46)	(112,91)	40.606,44
SDIL11	355.655,30	16.464,14	14.209,43	0,01%	12.120,03	46,47	(15.832,27)
SEER3	432.806,66	74.091,21	(16.007,06)	-0,02%	85.295,02	303,63	(93.856,92)
SMFT3	165.110,00	34.521,08	25.915,99	0,03%	-	-	-
SOMA3	2.222.863,52	473.422,44	390.153,53	0,40%	540.415,23	1.886,75	(569.072,30)
SPY	8.974.944,58	395.089,04	(203.768,43)	-0,21%	(1.012.645,87)	(80.774,50)	1.585.578,41
SQIA3	125.779,00	26.045,83	19.403,12	0,02%	59.945,21	191,26	(51.716,15)
STBP3	7.488.395,00	1.830.742,42	1.649.129,68	1,71%	2.402.161,58	8.127,12	(2.357.533,54)
SULA11	2.994.644,16	214.556,42	(61.059,68)	-0,06%	807.059,64	2.787,25	(829.342,63)
SUZB3	16.859.619,37	2.625.271,91	273.895,53	0,28%	6.451.184,48	21.309,63	(6.004.420,10)
SYNE3	275.851,00	42.127,53	(34.479,20)	-0,04%	-	-	-
TAEE11	414.498,05	24.209,49	(9.484,76)	-0,01%	26.871,30	101,52	(33.912,62)
TEND3	1.678.019,00	137.345,87	34.250,51	0,04%	568.986,71	1.911,26	(549.578,75)
TEPP11	7.668.582,93	504.147,16	236.271,28	0,24%	(74.297,41)	(291,07)	102.129,03
TIMS3	2.677.653,00	168.044,21	109.739,40	0,11%	196.006,10	737,59	(245.101,83)
TOTS3	10.246.331,04	1.552.310,11	981.159,87	1,02%	3.366.945,61	11.356,24	(3.281.861,87)
TRXF11	13.228.206,60	192.353,55	84.241,32	0,09%	(62.677,96)	(244,94)	85.651,54
UGPA1	415,51	136,84	1,23	0,00%	-	-	-
UGPA3	8.284.573,43	1.246.292,27	418.905,68	0,43%	800.937,56	2.981,25	(976.438,43)
USIM5	7.850.862,46	1.279.951,60	249.223,05	0,26%	1.058.919,19	3.873,65	(1.240.180,07)
VALE3	62.792.105,20	6.690.950,66	(2.629.114,41)	-2,72%	16.775.128,79	57.989,93	(17.275.429,89)
VBBR3	4.736.622,30	464.425,63	384.934,07	0,40%	-	-	-
VIIA3	523.862,43	99.073,75	36.358,74	0,04%	-	-	-
VISC11	6.600,00	411,41	(56,42)	0,00%	(187,13)	(0,74)	263,07
VITT3	249.795,60	3.122.575,21	1.421.594,41	1,47%	-	-	-
VIVT3	1.032.255,00	90.809,56	(35.506,39)	-0,04%	(65.004,34)	(261,73)	95.391,87
VTV_US	6.958.335,18	306.315,21	(157.983,04)	-0,16%	(785.111,18)	(62.625,02)	1.229.309,66
VVPR11	1.302.160,00	-	-	0,00%	-	-	-
WEGE3	15.195.478,74	1.511.933,86	1.210.743,08	1,25%	(766.480,24)	(3.065,93)	1.107.238,18



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.653.621.890,68	VAR / PL:	2,645%
VAR:	96.641.011,90	ETL / PL:	3,3170%
ETL:	121.191.769,33	VAR / CDI:	9041,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(150.079.743,37)	BAIXA 1:	256.617.250,22	Cenário 1:	474.936.158,29
				Cenário 2:	(70.934.631,85)
				Cenário 3:	65.535,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
WEST3	43.070,00	53.728,37	35.116,92	0,04%	-	-	-
WSPZ21	3.199.418,78	188.787,12	(151.466,49)	-0,16%	(360.991,44)	(28.794,77)	565.232,39
XPIN11	1.857.200,40	43.513,32	644,40	0,00%	121.598,37	-	(153.352,58)
XPIN13	294.229,80	-	-	0,00%	-	-	-
XPIN14	2.842.600,00	-	-	0,00%	-	-	-
XPPR11	3.405.612,80	136.179,98	35.610,46	0,04%	33.996,44	-	(45.659,81)
YDUQ3	957.592,80	158.907,07	44.862,54	0,05%	135.211,88	493,22	(157.330,87)
INDZ21	9.241.053,00	372.311,90	117.056,75	0,12%	-	-	-
WINZ21	318.657,00	12.838,34	4.036,44	0,00%	-	-	-
DH1X21	(109.967.792,78)	1.978,38	(1.114,23)	0,00%	(5.117,96)	2.661,53	7.899,62
DH1F22	125.914.185,13	149.635,55	130.802,45	0,14%	281.559,40	(146.060,27)	(432.800,33)
DH1J22	42.446.810,63	179.048,70	157.516,95	0,16%	270.749,94	(139.768,32)	(412.809,75)
DH1N22	(1.489.070,20)	12.525,93	(11.045,93)	-0,01%	(16.756,95)	8.607,44	25.338,51
DAPQ22	20.975.378,23	307.973,57	267.707,45	0,28%	128.673,56	(46.751,24)	(281.505,54)
DH1V22	900.295,99	11.896,01	10.535,96	0,01%	14.881,33	(7.608,69)	(22.329,84)
DH1F23	(5.058.237,03)	86.905,03	(77.432,42)	-0,08%	(108.691,94)	55.352,00	162.017,92
DAPK23	28.169.703,53	507.031,13	459.697,91	0,48%	391.827,39	(141.562,06)	(845.957,02)
DH1N23	1.559.770,85	36.593,63	32.823,19	0,03%	48.626,23	(24.580,65)	(71.598,38)
DH1F24	18.611.730,22	507.647,20	453.375,66	0,47%	754.798,86	(378.925,11)	(1.098.724,82)
DH1N24	805.003,75	24.425,95	21.606,29	0,02%	40.173,22	(20.032,40)	(57.829,62)
DAPQ24	24.914.056,80	576.610,89	526.944,31	0,55%	647.733,50	(232.103,17)	(1.371.890,72)
DH1F25	5.163.640,94	173.551,21	151.294,46	0,16%	308.871,03	(152.934,89)	(439.461,85)
DAPK25	8.104.172,95	197.957,70	183.166,48	0,19%	-	-	-
DH1F26	367.532,57	15.328,44	12.969,05	0,01%	29.207,80	(14.259,76)	(40.602,99)
DAPQ26	4.641.824,64	123.838,44	115.833,16	0,12%	-	-	-
DH1F27	8.177.191,98	401.688,08	336.431,91	0,35%	812.492,88	(391.141,99)	(1.103.707,74)
DAPQ28	(6.932.936,70)	221.037,25	(210.047,40)	-0,22%	-	-	-
DH1F29	6.601.841,98	405.675,84	323.522,58	0,33%	925.396,34	(433.231,26)	(1.200.953,82)
DAPQ30	(23,07)	0,88	(0,84)	0,00%	(1,86)	0,64	3,62
DH1F31	241.191,62	17.363,05	13.097,60	0,01%	43.646,43	(19.884,23)	(54.187,69)
DAPK35	98.875,16	5.578,65	5.289,15	0,01%	-	-	-
AUSZ21	861.357,83	45.283,59	(18.775,39)	-0,02%	345,34	7.830,67	(469,06)
EUPZ21	(1.320.419,75)	27.662,09	(2.232,18)	0,00%	(60.356,91)	(11.991,72)	77.812,61
NZLZ21	821.029,89	39.175,98	(8.547,70)	-0,01%	18.466,02	7.458,03	(24.444,30)
SWIZ21	1.105.394,92	42.727,18	7.340,47	0,01%	(22.122,95)	(9.945,05)	30.789,00
WDOZ21	(56.428,61)	2.489,01	1.292,64	0,00%	6.415,90	479,35	(10.069,61)
COMPROMISSADA	363.799.493,25	6.544,94	3.686,13	0,00%	16.931,43	(8.804,98)	(26.133,82)
EMP AÇÃO PROVISÃO	4.568,09	1,60	1,35	0,00%	3,41	(1,77)	(5,26)
DE252 AEGEA SA CDI - AEGP13	1.061.907,67	88,87	68,67	0,00%	154,65	(79,10)	(232,24)
DE252 AERIS CDI - AERI11	1.267.646,30	1.435,77	1.273,17	0,00%	2.218,70	(1.114,31)	(3.232,38)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.653.621.890,68	VAR / PL:	2,645%
VAR:	96.641.011,90	ETL / PL:	3,3170%
ETL:	121.191.769,33	VAR / CDI:	9041,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(150.079.743,37)	BAIXA 1:	256.617.250,22	Cenário 1:	474.936.158,29
				Cenário 2:	(70.934.631,85)
				Cenário 3:	65.535,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 ALIANSCA CDI - ALSA00	3.948.621,90	34.504,26	28.360,99	0,03%	69.277,96	(33.529,30)	(94.915,31)
DE252 AMPL CDI - AMPLA0	2.067.368,38	3.412,05	(3.063,12)	0,00%	(4.740,37)	2.405,20	7.023,54
DE252 AUTOBAN CDI - ANHB10	916.047,83	367,23	319,52	0,00%	604,97	(302,89)	(876,89)
DE252 AUTOPIST CDI - APRB28	1.517.042,43	639,67	552,43	0,00%	1.109,20	(551,66)	(1.590,26)
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.711.244,34	422,96	367,10	0,00%	652,37	(331,04)	(966,82)
DE252 BCBF CDI - BCBF14	268.679,23	239,99	212,75	0,00%	363,64	(183,06)	(531,84)
DE252 BCBF CDI - BCBF15	2.681.917,58	2.498,44	2.213,73	0,00%	3.797,27	(1.909,64)	(5.544,26)
DE252 BKBR CDI - BKBR18	1.442.234,39	677,67	597,49	0,00%	1.014,92	(512,46)	(1.491,73)
DE252 BRKA CDI - BRKP18	2.647.511,76	4.191,92	3.725,53	0,00%	6.374,36	(3.203,38)	(9.295,81)
DE252 BRML CDI - BRML17	3.172.327,14	5.948,40	(5.173,20)	-0,01%	(10.456,21)	5.209,43	15.031,78
DE252 CCPR CDI - CCPRA3	2.141.821,23	1.690,01	525,41	0,00%	(3.108,49)	1.399,93	3.758,56
DE252 CEA MODA CDI - CEAB11	2.165.463,52	1.661,99	1.473,76	0,00%	2.499,85	(1.259,59)	(3.661,52)
DE252 CELPA CDI - CELP15	2.541.363,81	181,50	128,98	0,00%	312,53	(160,09)	(470,53)
DE252 CONT GLO CDI - CGBP13	2.380.379,04	4.168,91	3.617,73	0,00%	7.539,75	(3.695,48)	(10.553,89)
DE252 COPEL GT CDI - CPGT14	296.620,83	1.131,73	(1.012,33)	0,00%	(1.485,15)	760,16	2.232,61
DE252 COPEL GT CDI - CPGT16	294.731,84	578,42	(518,38)	0,00%	(855,88)	432,47	1.259,46
DE252 CORSAN CDI - RSAN24	1.577.936,34	20.817,69	17.810,72	0,02%	37.587,18	(18.584,08)	(53.321,62)
DE252 COSAN LO CDI - RLOG11	1.639.339,99	1.319,89	1.169,11	0,00%	2.002,35	(1.008,67)	(2.931,67)
DE252 CSAN CDI - CSAN23	1.131.674,35	3.687,34	3.129,39	0,00%	7.343,25	(3.531,00)	(9.962,92)
DE252 DASA CDI - DASAA2	2.706.863,06	849,19	743,01	0,00%	1.289,55	(652,34)	(1.901,29)
DE252 ECORODOV CDI - ERDV18	1.767.939,27	24.229,15	19.903,98	0,02%	52.087,83	(24.640,78)	(68.761,86)
DE252 ECORODOV CDI - ERDVA0	2.162.684,39	795,00	697,70	0,00%	1.132,23	(578,82)	(1.698,68)
DE252 ELEKTRO CDI - ELEK27	566.213,66	1.321,16	(1.186,15)	0,00%	(1.651,45)	843,23	2.472,57
DE252 ELETROB CDI - ELET13	2.065.995,35	2.502,56	2.199,31	0,00%	4.131,80	(2.059,41)	(5.944,30)
DE252 ENER TR CDI - ETEN13	7.294.369,10	146.317,28	126.086,50	0,13%	285.625,59	(136.960,53)	(385.886,43)
DE252 ENERSUL CDI - ESUL18	995.095,10	955,99	(849,27)	0,00%	(1.150,39)	596,10	1.765,04
DE252 EQUATENE CDI - EQTL13	1.449.763,87	637,83	562,02	0,00%	956,66	(483,24)	(1.407,03)
DE252 GETI CDI - TIET19	1.857.220,01	14.362,80	11.265,50	0,01%	34.290,18	(15.836,99)	(43.540,92)
DE252 GETI CDI - TIET27	1.024.147,43	37,54	1,74	0,00%	54,38	(27,92)	(82,23)
DE252 GUAR CDI - GUAR24	2.791.164,75	3.286,16	2.919,49	0,00%	4.960,68	(2.495,83)	(7.248,18)
DE252 GUARIROB CDI - GRRB14	1.076.189,57	525,82	457,45	0,00%	887,33	(442,86)	(1.279,45)
DE252 IGUATEMI CDI - IGTA19	2.402.347,60	605,96	524,75	0,00%	888,10	(454,56)	(1.335,11)
DE252 IGUATEMI CDI - IGTA37	2.117.396,65	4.514,05	(3.998,27)	0,00%	(7.598,16)	3.809,06	11.035,51
DE252 INTERVIA CDI - IVIA35	1.338.369,98	641,93	565,73	0,00%	984,22	(495,95)	(1.441,78)
DE252 LOCALIZA CDI - LORTA1	1.156.113,36	231,18	(197,86)	0,00%	(343,98)	178,56	529,30
DE252 LOCAMERI CDI - LCAMA9	1.969.625,01	2.332,72	2.064,71	0,00%	3.680,18	(1.844,32)	(5.342,37)
DE252 MOV_PART CDI - MOV116	1.093.923,90	1.606,82	1.417,74	0,00%	2.609,77	(1.301,33)	(3.757,46)
DE252 MOV_PART CDI - MOV127	1.189.195,05	4.060,15	3.509,14	0,00%	7.520,01	(3.669,15)	(10.447,85)
DE252 MOV_PART CDI - MOV133	1.434.520,56	70,25	(46,75)	0,00%	0,03	-	(0,04)
DE252 MULTIPLA CDI - MULP16	3.181.198,63	5.312,57	(4.733,10)	0,00%	(8.262,36)	4.162,50	12.098,37



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.653.621.890,68	VAR / PL:	2,645%
VAR:	96.641.011,90	ETL / PL:	3,3170%
ETL:	121.191.769,33	VAR / CDI:	9041,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(150.079.743,37)	BAIXA 1:	256.617.250,22	Cenário 1:	474.936.158,29
				Cenário 2:	(70.934.631,85)
				Cenário 3:	65.535,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 OMEGA GE CDI - OM GE13	3.276.534,57	5.982,53	5.185,54	0,01%	10.872,28	(5.326,89)	(15.208,91)
DE252 OURO VER CDI - OV SA10	1.566.438,46	2.181,00	1.925,50	0,00%	3.535,34	(1.765,44)	(5.102,12)
DE252 PROLAGOS CDI - PRLG14	3.250.426,06	45.543,32	(40.720,15)	-0,04%	(67.002,46)	33.702,55	97.851,04
DE252 RD COLIN CDI - RDCO10	3.196.203,88	44.410,32	38.182,39	0,04%	80.917,57	(39.965,93)	(114.528,39)
DE252 RENNEN CDI - LRENB1	1.399.666,31	700,49	618,34	0,00%	1.057,43	(533,95)	(1.554,33)
DE252 RT BANDE CDI - CBAN22	3.412.382,56	4.150,39	3.644,33	0,00%	6.951,24	(3.456,71)	(9.963,20)
DE252 S LUIZ A CDI - RDORB9	1.119.235,91	3.498,43	2.968,14	0,00%	6.970,97	(3.351,69)	(9.456,44)
DE252 SABESP CDI - SBSPC3	1.223.902,28	524,40	452,22	0,00%	911,92	(453,29)	(1.306,19)
DE252 SANEAMEN CDI - SNGO18	2.612.633,52	2.095,54	1.856,15	0,00%	3.193,41	(1.607,59)	(4.670,46)
DE252 SBF COME CDI - SBFC11	4.068.374,42	50.128,58	43.731,97	0,05%	84.953,22	(42.554,79)	(123.101,76)
DE252 SIMPAR CDI - JSMLA5	1.194.744,02	5.921,02	5.062,87	0,01%	11.520,90	(5.564,19)	(15.742,68)
DE252 SUL AME CDI - SULM15	654.622,47	738,65	(656,51)	0,00%	(879,09)	452,34	1.333,13
DE252 TELEF BR CDI - VIVT15	4.986.565,20	51.490,44	46.122,82	0,05%	56.153,11	(29.344,92)	(87.215,75)
DE252 USIMINAS CDI - USIM17	3.346.367,86	18.595,82	16.666,75	0,02%	23.793,67	(12.138,92)	(35.557,98)
DE252 VAMOS CDI - VAMO22	1.098.302,63	1.152,37	1.016,28	0,00%	1.855,64	(927,69)	(2.683,01)
DE252 VAMOS CDI - VAMO23	296.492,61	1.244,70	1.059,70	0,00%	2.458,94	(1.183,87)	(3.342,97)
DE252 VIX LOGI CDI - VIXL14	1.060.972,10	1.189,33	1.053,37	0,00%	1.853,68	(929,78)	(2.694,84)
LF selic	8.082.554,97	10.842,83	(9.664,55)	-0,01%	(16.766,26)	8.728,85	25.927,74
LF252 ABC CDI - LF002100BMM	1.036.205,46	50,74	(33,77)	0,00%	0,02	-	(0,03)
LF252 ABC CDI - LF002100BMX	1.036.205,46	50,74	(33,77)	0,00%	0,02	-	(0,03)
LF252 B.ALFA CDI - LF0021006S0	1.008.423,71	49,38	(32,87)	0,00%	0,02	(0,00)	(0,03)
LF252 CNH CDI - LF0021003Q1	1.929.536,92	94,49	(62,88)	0,00%	0,04	0,00	(0,05)
LF252 DAYCOVAL CDI - LF002100HDP	1.200.969,36	58,81	(39,14)	0,00%	0,02	0,00	(0,03)
LF252 DAYCOVAL CDI - LF002100HQD	2.187.853,12	107,14	(71,30)	0,00%	0,04	-	(0,06)
LF252 PANAMERI CDI - LF002100E1F	1.034.326,59	50,65	(33,71)	0,00%	0,02	(0,00)	(0,03)
LF252 PARANA B CDI - LF002100BC4	1.562.604,43	76,52	(50,93)	0,00%	0,03	-	(0,04)
LFSN BRADESCO CDI - LFSN210029N	3.405.341,37	166,75	(110,98)	0,00%	0,07	-	(0,09)
LFT	38.786.338,30	27.559,89	(17.171,73)	-0,02%	0,76	-	(1,04)
LFV TOYOTA CDI - LF002100ISJ	2.242.991,08	109,84	(73,10)	0,00%	0,04	(0,00)	(0,06)
CMTR33	5.338.429,81	50.565,49	26.620,64	0,03%	(1.353,86)	497,63	3.043,84
CRI RB CAPIT IPCA M D - 17H0164854	7.847.685,73	153.304,42	142.003,94	0,15%	183.893,82	(64.347,23)	(368.711,52)
DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23	11.587.705,46	252.291,27	232.389,85	0,24%	289.634,89	(103.041,97)	(594.223,25)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.914.099,97	94.722,37	86.633,03	0,09%	94.731,48	(33.480,48)	(197.188,54)
DE252 CEMIG - IPCA CMDT33	2.509.794,84	41.656,56	37.181,47	0,04%	36.429,78	(13.075,44)	(77.457,90)
DE252 COM GAS IGPIM-100 - GASP17	37.687.228,34	699.494,65	658.026,66	0,68%	1.522.330,38	(14.325,10)	-nan(ind)
DE252 CSAN IPCA - CSAN33	5.323.441,58	149.068,90	142.541,51	0,15%	277.259,49	(92.745,08)	(514.895,20)
DE252 CSMG IPCA - CSMGC3	12.734.081,79	241.497,58	220.871,81	0,23%	240.266,28	(85.195,19)	(497.576,37)
DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24	13.805.490,33	220.158,90	199.377,15	0,21%	136.751,89	(49.452,23)	(295.893,66)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	10.126.547,56	216.844,23	199.787,90	0,21%	244.137,43	(87.074,17)	(500.472,77)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36	3.276.066,65	63.148,24	57.755,36	0,06%	63.154,32	(22.320,32)	(131.459,02)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.653.621.890,68	VAR / PL:	2,645%
VAR:	96.641.011,90	ETL / PL:	3,3170%
ETL:	121.191.769,33	VAR / CDI:	9041,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(150.079.743,37)	BAIXA 1:	256.617.250,22	Cenário 1:	474.936.158,29
				Cenário 2:	(70.934.631,85)
				Cenário 3:	65.535,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	3.011.935,04	26.576,50	20.180,59	0,02%	9.414,42	(3.401,44)	(20.326,10)
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	455.381,29	5.413,07	4.330,82	0,00%	570,65	(208,80)	(1.269,30)
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	598.641,05	8.408,07	7.242,12	0,01%	2.864,55	(1.042,14)	(6.286,06)
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	984.020,21	15.565,99	13.610,88	0,01%	8.439,19	(3.060,04)	(18.375,62)
DE252 IMED - IPCA SULM23	1.113.047,37	13.301,42	10.946,78	0,01%	2.287,07	(835,54)	(5.041,28)
DE252 IRB IPCA - IRBR12	13.250.804,01	300.569,05	278.987,84	0,29%	428.739,38	(150.491,54)	(849.725,56)
DE252 LIGHT IPCA - LIGHD7	4.508.239,16	109.093,96	101.131,71	0,10%	154.378,02	(53.515,77)	(312.899,50)
DE252 LIGHT IPCA - LSVE29	4.666.331,36	64.359,16	57.599,72	0,06%	32.589,35	(11.671,38)	(69.920,07)
DE252 LOCALIZA IPCA - LORTA7	8.329.159,51	241.593,49	230.695,57	0,24%	449.882,95	(148.911,87)	(835.670,05)
DE252 LOCAMERI IPCA - LCAMD1	9.708.913,39	279.333,73	267.655,70	0,28%	525.172,55	(179.062,54)	(962.142,29)
DE252 MOV_PART IPCA - MOVI37	2.862.784,09	82.509,68	79.189,41	0,08%	156.839,53	(54.842,85)	(282.670,22)
DE252 MOVIDA L IPCA - MVLV16	5.751.458,34	179.869,30	172.258,36	0,18%	352.587,15	(123.462,33)	(707.867,54)
DE252 PETR IPCA - PETR45	13.611.442,13	271.546,47	248.495,15	0,26%	257.746,22	(91.602,35)	(542.811,40)
DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34	8.252.469,97	90.505,25	81.941,50	0,08%	61.182,70	(25.132,04)	(118.532,18)
DE252 SABESP - IPCA SBESCP7	10.106.340,86	105.228,69	87.261,16	0,09%	49.822,49	(18.018,18)	(107.814,79)
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	13.736.465,51	272.304,13	246.934,25	0,26%	283.827,08	(100.389,91)	(588.838,30)
DE252 SIMPAR IPCA M D - JSMLB5	881.256,87	25.537,05	24.521,71	0,03%	48.775,68	(17.169,67)	(87.517,59)
DE252 TRANS AL - IPCA TAEE33	10.940.838,76	210.152,33	192.501,32	0,20%	190.721,63	(68.580,44)	(407.268,05)
DE252 VAMOS IPCA - VAMO33	5.847.776,38	160.969,66	154.291,15	0,16%	299.232,35	(101.831,37)	(551.941,24)
DEBI AESTUCAN IPCA - TCII11	4.636.935,62	160.019,98	152.506,81	0,16%	319.668,61	(105.205,96)	(560.807,62)
DEBI ALGA IPCA - ALGAB1	3.066.005,94	85.014,98	81.175,93	0,08%	156.941,10	(51.407,12)	(295.795,13)
DEBI ANEMUS IPCA - ANEM11	4.398.329,53	139.384,94	133.406,14	0,14%	270.617,18	(92.608,95)	(470.680,55)
DEBI ANET IPCA - ANET11	6.402.606,03	145.222,94	135.514,22	0,14%	198.622,46	(68.407,72)	(395.382,02)
DEBI B2W IPCA - BTOW15	8.649.347,32	243.001,80	233.094,75	0,24%	460.463,40	(158.506,40)	(834.815,56)
DEBI BRISANET IPCA - BRST11	4.536.896,79	108.035,37	100.599,77	0,10%	157.237,38	(54.296,93)	(312.150,04)
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	7.748.230,45	240.200,87	226.591,45	0,23%	437.894,44	(138.466,93)	(817.402,46)
DEBI CAGECE IPCA - CAEC21	8.529.671,66	161.234,08	142.016,66	0,15%	233.379,26	(56.129,64)	(557.345,22)
DEBI CART IPCA - CART13	4.337.082,98	128.256,45	122.966,38	0,13%	241.370,12	(82.489,45)	(435.130,20)
DEBI CEEED IPCA - CEEED21	3.950.157,86	103.439,84	98.634,40	0,10%	182.540,17	(61.347,78)	(349.133,80)
DEBI CELP IPCA - CEPEC1	2.062.090,31	60.362,81	57.862,62	0,06%	113.282,76	(37.977,63)	(209.455,88)
DEBI COELBA IPCA - CEEBC3	2.056.430,71	60.189,85	57.687,83	0,06%	112.879,02	(37.787,81)	(208.895,43)
DEBI COMGAS IPCA - GASP19	3.153.025,61	90.473,27	86.572,54	0,09%	165.983,25	(54.632,46)	(312.501,86)
DEBI CORSAN IPCA - RSNAN4	5.430.615,27	135.523,18	128.055,41	0,13%	219.184,55	(73.043,85)	(427.757,41)
DEBI CTEEP IPCA - CTEEP29	937.959,54	27.503,70	25.996,70	0,03%	51.398,10	(16.278,91)	(90.316,32)
DEBI ECHOENER IPCA - ECHP11	1.276.534,32	40.322,92	37.701,72	0,04%	82.566,50	(32.842,56)	(131.818,63)
DEBI ECHOENER IPCA - ECHP22	1.643.126,34	39.038,47	36.925,57	0,04%	58.373,36	(19.569,58)	(115.292,88)
DEBI EDPM IPCA - MGSP12	1.901.599,66	50.724,43	47.750,41	0,05%	89.709,06	(28.006,05)	(165.679,45)
DEBI ELEKTRO IPCA - EKTRC0	2.050.759,11	60.016,71	57.512,67	0,06%	112.474,45	(37.597,59)	(208.333,81)
DEBI ELETROB IPCA - ELET23	1.968.759,27	58.736,87	56.005,96	0,06%	109.404,11	(35.473,12)	(204.447,59)
DEBI ELETROB IPCA - ELET42	11.544.837,51	281.822,57	267.651,11	0,28%	473.100,08	(159.180,08)	(919.801,53)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.653.621.890,68	VAR / PL:	2,645%
VAR:	96.641.011,90	ETL / PL:	3,3170%
ETL:	121.191.769,33	VAR / CDI:	9041,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(150.079.743,37)	BAIXA 1:	256.617.250,22	Cenário 1:	474.936.158,29
				Cenário 2:	(70.934.631,85)
				Cenário 3:	65.535,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DEBI ENERGISA IPCA - ENGIA5	2.918.871,20	85.486,65	81.994,26	0,08%	160.874,70	(54.240,11)	(296.401,61)
DEBI ENERGMIR IPCA - ENMI21	988.860,67	20.803,39	19.265,45	0,02%	26.394,11	(9.272,58)	(52.976,68)
DEBI ENSINOP IPCA - CSNP12	571.466,48	14.220,57	13.563,67	0,01%	24.243,00	(8.565,34)	(44.688,95)
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	25.902.906,69	636.201,90	606.473,20	0,63%	1.119.808,61	(394.996,09)	(2.085.233,66)
DEBI HOLDARAG IPCA - HARG11	7.066.747,85	222.301,94	212.522,64	0,22%	429.612,46	(144.945,68)	(758.245,15)
DEBI IGUA SAN IPCA - IGSN15	10.432.176,90	279.858,26	267.176,65	0,28%	503.548,92	(169.672,62)	(927.958,31)
DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21	1.639.263,84	33.655,91	31.130,98	0,03%	41.599,89	(14.623,70)	(83.674,90)
DEBI LAME IPCA - LAMEA6	8.329.094,73	244.333,06	234.915,45	0,24%	464.934,36	(161.759,46)	(840.093,64)
DEBI METRORIO IPCA - MTRJ19	9.818.749,31	265.841,73	253.318,34	0,26%	452.702,66	(158.120,27)	(855.440,05)
DEBI MG050 IPCA - CRMG15	4.359.792,82	105.154,01	99.748,51	0,10%	168.560,99	(57.578,37)	(323.176,18)
DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16	5.700.398,41	146.846,35	139.483,94	0,14%	243.375,66	(80.080,67)	(481.696,25)
DEBI NORTE EN IPCA - NTEEN1	8.178.194,32	194.864,39	184.826,31	0,19%	317.977,84	(111.600,26)	(605.117,46)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS11	1.146.841,58	26.032,23	24.406,48	0,03%	35.867,09	(12.490,30)	(71.052,00)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS21	3.357.232,22	108.437,96	103.911,45	0,11%	218.289,86	(75.142,55)	(376.819,44)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS22	2.356.428,09	70.323,20	67.316,80	0,07%	132.896,31	(44.194,66)	(244.088,13)
DEBI PARANAGU IPCA - PASN12	697.070,43	14.574,45	13.689,39	0,01%	20.707,61	(7.149,84)	(40.435,74)
DEBI QUATA IPCA - QUAT12	4.340.087,97	93.921,87	86.740,42	0,09%	124.915,99	(44.304,73)	(249.823,63)
DEBI RIO PR IPCA - RIPR22	510.987,28	13.971,50	13.312,73	0,01%	25.331,34	(8.208,00)	(48.140,43)
DEBI TAUBATE IPCA - LTTE15	9.084.869,78	254.417,20	241.799,43	0,25%	441.117,30	(143.241,78)	(815.015,86)
DEBI TUCANOHO IPCA - TNHL11	3.281.375,43	112.274,76	107.188,86	0,11%	224.393,50	(75.232,22)	(393.055,87)
DEBI UTE GNA IPCA - UNEG11	1.013.746,58	35.385,76	33.566,22	0,03%	70.893,95	(23.091,16)	(123.151,18)
DEBI VENSJOR IPCA - VSJH11	1.284.953,81	27.518,21	25.797,26	0,03%	39.325,64	(14.197,96)	(75.666,53)
DEBI VIARONDO IPCA - VRDN12	9.765.490,42	268.894,14	256.336,89	0,27%	488.012,43	(161.470,44)	(902.248,37)
ECCR32	3.220.091,74	50.937,91	44.540,03	0,05%	27.616,27	(10.013,63)	(60.132,07)
LF ipca	1.315.988,51	11.859,33	9.274,75	0,01%	12.674,28	(4.590,61)	(27.526,13)
LFS ITAU IPCA - LFS0120016V	5.055.215,73	74.644,08	64.937,05	0,07%	31.920,24	(11.595,82)	(69.807,69)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GU	790.648,79	12.770,89	11.219,17	0,01%	7.351,65	(2.664,22)	(15.986,74)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GZ	3.953.243,96	63.854,43	56.095,85	0,06%	36.758,23	(13.321,08)	(79.933,69)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H2	9.487.785,50	153.250,62	134.630,04	0,14%	88.219,75	(31.970,60)	(191.840,86)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H4	7.115.839,13	114.937,97	100.972,53	0,10%	66.164,82	(23.977,95)	(143.880,64)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H6	5.534.541,54	89.396,20	78.534,19	0,08%	51.461,52	(18.649,51)	(111.907,17)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001IP	7.917.748,35	128.450,19	113.380,22	0,12%	75.030,23	(27.187,56)	(163.114,39)
LFSN BRADESCO IPCA - LFSN16000GM	11.571.348,50	281.780,54	257.630,47	0,27%	348.413,74	(124.508,85)	(733.278,49)
LFSN BRADESCO IPCA M D - LFSN1800DC5	3.732.875,65	94.481,40	86.565,51	0,09%	129.503,16	(46.140,65)	(270.660,01)
NTNB	1.744.500.926,01	68.138.678,44	65.449.910,56	67,72%	195.638.391,37	(62.798.737,24)	(324.875.003,80)
IDIFQHM	(36,39)	191,72	(157,08)	0,00%	(0,00)	33,53	35,29
IDIFQHN	82,39	416,88	341,56	0,00%	0,00	(75,53)	(79,99)
IDIJQF5	(117,26)	768,85	(696,72)	0,00%	0,08	132,81	133,65
IDIJQF6	181,19	1.150,59	1.042,63	0,00%	(0,44)	(204,17)	(205,66)
AB AMERICAN GROWTH	9.549.964,64	490.782,35	(328.463,01)	-0,34%	0,61	(85.949,68)	1.687.165,60



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.653.621.890,68	VAR / PL:	2,645%
VAR:	96.641.011,90	ETL / PL:	3,3170%
ETL:	121.191.769,33	VAR / CDI:	9041,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(150.079.743,37)	BAIXA 1:	256.617.250,22	Cenário 1:	474.936.158,29
				Cenário 2:	(70.934.631,85)
				Cenário 3:	65.535,00

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
BR ELETRO FIDC S1	12.235,12	76.732,56	43.583,85	0,05%	(12.798.434,44)	-	(12.235,09)
FARM SYN AGRO FIDC	3.255.557,42	6.379,85	(5.540,67)	-0,01%	13.490.052,19	-	15.854,47
FIDC CELG DIST SN B	3.559.439,51	17.315,37	(4.834,86)	-0,01%	(1.009.426,24)	1.140,28	(376.007,91)
FIDC CREZ MZ4	980.864,73	4.551,55	(3.647,79)	0,00%	1.043.953,96	-	(65.618,80)
FIDC VERDECARD SN4	7.741.572,54	173,54	103,32	0,00%	(1.077.525,56)	-	(81.263,29)
FII HSI LOGISTICA	452.039,40	19.852,32	(5.847,34)	-0,01%	149.743.288,94	-	-
FII VIA PQ SHOPPING	1.694.375,94	-	-	0,00%	(11.618,04)	-	-
FUNDSMITH EQ FUND	10.880.007,14	544.651,89	(319.019,26)	-0,33%	304.782,27	(97.920,06)	1.922.140,50
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.472.638,81	122.332,15	39.824,85	0,04%	51.274,52	-	-
JANUS H GL FICFIA IE	3.820.655,62	91.476,75	35.716,83	0,04%	60.350,94	-	-
LOOMIS US GROWTH	8.048.791,64	523.950,02	(360.563,85)	-0,37%	26.645,28	(72.439,12)	1.421.957,56
MFS MERIDIAN EUROPEA	7.257.794,57	440.184,15	(340.350,30)	-0,35%	-	(65.320,15)	1.282.214,31
PICTET GL FIC FIM IE	3.780.388,53	83.569,43	29.826,64	0,03%	(1.227.594,68)	-	-
RB CAP CREDIT AL SN4	386.776,07	3.731,66	(831,77)	0,00%	-	-	-
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	2.999.829,82	37.931,27	(27.094,12)	-0,03%	-	-	-
WELLINGTON GLO QUAL	10.850.873,93	511.595,84	(324.907,38)	-0,34%	(908.147,73)	(97.657,87)	1.916.993,62
Total	3.867.051.635,80	185.087.541,73	96.641.011,90	1,00	474.936.158,29	(70.934.631,85)	65.535,00



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV RENDA FIXA CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	1.984.532.244,52	VAR / PL:	3,750%
VAR:	74.421.555,46	ETL / PL:	4,7028%
ETL:	93.327.664,98	VAR / CDI:	12818,04%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(167.169.171,96)	BAIXA 1:	211.530.011,08	Cenário 1:	175.019.555,92
				Cenário 2:	(63.181.037,49)
				Cenário 3:	(299.762.747,17)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	6.000,00	6,51	4,70	0,00%	(66,07)	(0,26)	90,97
RECEBER	(76.609,86)	83,07	(59,95)	0,00%	843,62	3,31	(1.161,48)
COMPROMISSADA	101.352.224,35	110.925,81	80.490,69	0,11%	(1.111.374,01)	(6.825,93)	1.529.319,00
CMTR33	5.341.972,78	52.662,22	35.856,04	0,05%	(60.366,15)	335,63	84.452,42
17H0164854	7.893.812,59	166.755,67	158.121,12	0,21%	91.021,18	(62.852,61)	(236.823,21)
AEGP23	11.665.768,54	273.576,49	255.904,94	0,34%	150.345,41	(99.961,15)	(395.286,53)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.943.559,01	103.244,67	96.179,90	0,13%	36.086,90	(32.317,15)	(113.494,68)
CMDT33	2.520.881,88	45.444,59	42.004,80	0,06%	7.037,93	(12.611,25)	(35.944,18)
GASP17	37.837.970,89	781.262,52	741.769,85	1,00%	1.088.478,38	(15.549,49)	(2.391.273,70)
CSMGC3	12.803.420,94	263.954,66	245.878,41	0,33%	89.384,94	(82.487,99)	(282.964,75)
GEPA24	13.848.224,05	243.878,03	227.796,96	0,31%	(22.838,39)	(47.522,83)	(71.123,62)
ERDV17	10.192.354,35	235.268,66	220.203,90	0,30%	122.650,10	(84.440,39)	(327.089,70)
ERDV36	3.295.706,01	68.829,78	64.119,93	0,09%	24.057,93	(21.544,76)	(75.663,12)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	3.016.099,42	29.678,48	25.278,19	0,03%	(24.340,13)	(3.337,80)	26.545,13
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	455.775,31	5.948,45	5.296,22	0,01%	(4.490,91)	(212,95)	5.734,74
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	599.374,49	9.313,60	8.528,77	0,01%	(3.878,66)	(1.016,40)	3.109,21
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	986.086,71	17.340,42	15.715,72	0,02%	(2.767,97)	(2.977,77)	(2.688,00)
SULM23	1.114.085,10	14.717,93	13.321,93	0,02%	(10.142,96)	(824,82)	12.203,67
DE252 PETR IPCA - PETR45	13.695.464,28	296.604,09	275.559,71	0,37%	94.818,66	(88.136,85)	(310.079,58)
RDCO34	8.267.936,59	102.482,39	95.285,29	0,13%	(32.108,04)	(24.688,12)	11.468,58
SBESC7	10.124.559,58	118.031,21	105.075,21	0,14%	(64.262,17)	(17.527,95)	51.147,22
SBSPC2	13.819.055,55	295.329,15	273.867,69	0,37%	119.905,46	(97.090,52)	(355.293,72)
TAE33	10.999.294,16	230.632,19	214.891,08	0,29%	60.736,33	(65.938,11)	(222.540,55)
ELET42	11.646.245,77	302.004,38	294.195,52	0,40%	333.806,09	(156.670,34)	(721.223,55)
ENMI21	995.440,14	22.533,71	21.328,66	0,03%	14.578,70	(9.047,81)	(36.150,35)
ENTV12	26.115.610,76	682.617,53	664.016,36	0,89%	809.606,78	(389.688,25)	(1.645.976,45)
IGSN15	2.206.497,00	62.873,20	61.520,43	0,08%	79.341,61	(35.164,24)	(157.277,18)
ENJG21	1.649.797,41	36.492,07	34.527,29	0,05%	22.057,29	(14.261,85)	(55.863,04)
NEOE16	5.753.553,08	156.988,05	153.485,36	0,21%	174.124,37	(78.702,26)	(382.743,14)
ECCR32	3.226.854,13	56.744,51	51.427,88	0,07%	(9.057,87)	(9.744,42)	(8.796,18)
LFS0120016V	5.061.115,49	82.848,09	75.709,84	0,10%	(25.257,08)	(11.294,44)	10.013,68
LFS012001GU	792.508,23	14.234,13	12.895,74	0,02%	(1.677,62)	(2.590,29)	(3.333,73)
LFS012001GZ	3.962.541,16	71.170,65	64.478,70	0,09%	(8.388,11)	(12.951,46)	(16.668,67)
LFS012001H2	9.510.098,78	170.809,57	154.748,87	0,21%	(20.131,47)	(31.083,49)	(40.004,81)
LFS012001H4	7.132.574,08	128.107,17	116.061,65	0,16%	(15.098,60)	(23.312,62)	(30.003,61)
LFS012001H6	5.547.557,62	99.638,91	90.270,17	0,12%	(11.743,36)	(18.132,04)	(23.336,14)
LFS012001IP	7.937.164,03	143.110,96	129.993,00	0,17%	(15.509,59)	(26.408,27)	(36.164,04)
LFSN16000GM	11.660.409,40	303.509,33	281.506,77	0,38%	207.117,42	(120.544,03)	(531.260,71)
LFSN1800DC5	3.760.841,58	101.507,37	94.704,65	0,13%	84.124,40	(44.939,63)	(206.023,98)
NTNB	1.641.742.325,50	68.939.010,59	68.919.593,47	92,61%	172.852.931,60	(61.428.975,89)	(292.780.579,38)
Total	2.023.404.150,89	74.840.170,80	74.421.555,46	100,00%	175.019.555,92	(63.181.037,49)	(299.762.747,17)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	694.068.854,55	VAR / PL:	3,972%
VAR:	27.571.515,45	ETL / PL:	4,9816%
ETL:	34.575.804,57	VAR / CDI:	13578,10%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.236,85)	BAIXA 1:	1.446,38	Cenário 1:	110.876.263,77
				Cenário 2:	339.234,36
				Cenário 3:	(81.698.917,98)

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	26.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	2.588.406,55	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	25.249.178,81	2.292.183,72	(298.162,74)	-1,08%	3.322.891,22	12.173,40	(3.904.878,10)
ALPA4	331.947,59	94.458,64	40.565,54	0,15%	204.549,16	621,88	(159.068,53)
ALSO3	1.436.582,00	136.836,08	110.568,47	0,40%	487.054,07	1.636,07	(470.459,40)
AMER3	3.487.403,70	849.852,40	1.004,52	0,00%	-	-	-
ASAI3	5.542.900,22	1.205.830,56	488.623,00	1,77%	-	-	-
AZUL4	420.153,78	104.506,49	74.215,14	0,27%	182.973,32	592,58	(163.078,47)
B3SA3	25.805.539,93	1.908.747,65	748.245,59	2,71%	6.413.460,66	22.341,09	(6.719.479,33)
UNT	18.987.844,15	1.855.035,12	1.447.507,61	5,25%	6.882.383,57	22.909,92	(6.515.671,48)
BBAS3	14.842.315,51	1.364.214,52	530.053,43	1,92%	(118.136,12)	(462,41)	162.055,65
BBDC3	1.208.445,00	120.539,92	24.636,02	0,09%	140.680,18	518,93	(167.957,04)
BBDC4	32.324.823,71	3.724.477,33	359.193,97	1,30%	2.772.827,43	10.373,23	(3.420.251,08)
BBRK3	19.182,00	3.212,96	1.479,53	0,01%	12.644,32	37,90	(9.541,88)
BBSE3	1.253.894,67	220.494,88	(58.373,42)	-0,21%	(204.770,66)	(871,31)	343.772,64
BEEF3	122.422,06	30.224,07	8.033,43	0,03%	(24.125,06)	(104,71)	42.541,92
BIDI11	5.003.583,00	1.411.616,64	847.351,81	3,07%	6.591.105,82	16.420,64	(3.406.553,58)
BIDI3	938,96	-	-	0,00%	-	-	-
BIDI4	126.604,96	31.275,85	20.385,46	0,07%	142.838,13	373,35	(81.241,13)
BMGB4	135.115,00	14.510,76	10.991,78	0,04%	35.438,01	122,75	(36.658,81)
BPAN4	3.247.677,30	360.874,88	310.184,97	1,13%	1.423.470,38	4.605,30	(1.265.832,29)
BRAP4	2.117.050,62	210.900,73	39.630,28	0,14%	231.874,73	858,01	(278.848,34)
BRFS3	972.477,49	172.008,31	82.975,50	0,30%	(3.881,22)	(15,16)	5.299,12
BRKM5	742.943,32	137.595,33	15.607,44	0,06%	176.771,43	618,49	(187.052,89)
BRML3	6.491.875,74	671.616,91	43.654,37	1,97%	2.156.744,10	7.264,07	(2.095.617,66)
CASH3	92.981,21	50.825,30	20.770,36	0,08%	107.031,16	-	(60.145,86)
CCRO3	657.293,58	67.757,94	31.400,31	0,11%	33.038,39	125,68	(42.376,22)
CESP6	11.607.192,00	731.920,36	(270.000,19)	-0,98%	(327.877,94)	(1.296,61)	460.881,80
CIEL3	2.848.375,32	500.924,86	43.587,79	0,16%	565.360,55	2.011,33	(621.256,84)
CLSA4	1.795.390,00	141.789,71	27.454,41	0,10%	-	-	-
CMIG4	739.852,96	97.311,31	68.348,01	0,25%	19.729,96	75,92	(25.992,20)
COGN3	235.929,84	30.304,23	12.911,43	0,05%	63.432,10	219,13	(65.221,75)
CPFE3	7.437.784,38	858.479,44	195.340,83	0,71%	974.659,47	3.571,56	(1.146.032,61)
CPLB6	477.021,76	64.395,08	43.774,05	0,16%	34.778,50	130,89	(43.503,80)
CRFB3	1.875.328,00	95.699,56	30.343,30	0,11%	167.455,24	625,43	(205.772,46)
CSAN3	1.193.673,43	156.025,95	81.137,56	0,29%	109.854,67	409,78	(134.594,81)
CSED3	2.513.848,00	382.289,94	206.848,70	0,75%	-	-	-
CSNA3	754.131,90	90.616,12	26.351,59	0,10%	416.414,60	1.293,75	(339.199,54)
CVCB3	185.459,61	48.975,76	27.694,59	0,10%	71.028,61	234,59	(66.090,54)
CYRE3	971.900,02	173.168,73	108.412,35	0,39%	449.381,35	1.441,16	(392.039,14)
DXCO3	218.799,57	22.083,69	11.551,32	0,04%	-	-	-
ECOR3	143.349,57	16.018,65	11.700,41	0,04%	41.062,25	140,84	(41.550,64)
EGIE3	5.260.865,46	269.848,98	(41.705,56)	-0,15%	138.471,71	532,90	(182.494,81)
ELET3	2.810.697,89	296.640,52	167.708,15	0,61%	224.869,67	843,51	(279.116,05)
ELET6	7.329.168,72	790.516,14	508.466,96	1,84%	773.590,19	2.867,74	(934.230,49)
ENAT3	2.125.314,00	517.425,09	90.507,51	0,33%	(299.384,48)	(1.257,67)	487.013,75
ENBR3	236.356,40	15.038,59	(1.090,07)	0,00%	(10.627,35)	(42,39)	15.247,89
ENEV3	3.506.558,40	425.388,85	187.726,54	0,68%	734.454,44	2.600,71	(798.539,82)
ENGI11	509.830,16	41.715,41	29.905,29	0,11%	36.925,21	139,00	(46.213,42)
EQTL3	11.734.030,88	1.105.519,21	558.274,63	2,02%	1.583.543,37	5.792,59	(1.854.465,99)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	694.068.854,55	VAR / PL:	3,972%
VAR:	27.571.515,45	ETL / PL:	4,9816%
ETL:	34.575.804,57	VAR / CDI:	13578,10%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.236,85)	BAIXA 1:	1.446,38	Cenário 1:	110.876.263,77
				Cenário 2:	339.234,36
				Cenário 3:	(81.698.917,98)

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
ESPA3	1.491.400,27	635.330,01	249.722,97	0,91%	-	-	-
EUCATEX PN	77.212,00	8.038,26	6.072,14	0,02%	19.471,22	67,73	(20.331,14)
EZTC3	95.374,50	15.367,52	10.553,56	0,04%	49.082,02	154,50	(41.122,45)
FLRY3	293.936,30	40.824,21	16.488,24	0,06%	111.651,84	369,20	(104.162,77)
GETT11	17.156,60	129.374,86	(38.247,77)	-0,14%	-	-	-
GGBR4	10.029.880,20	1.302.087,10	(23.350,88)	-0,08%	(485.072,95)	(1.938,21)	698.913,98
GGPS3	2.605.791,80	466.591,36	157.893,94	0,57%	-	-	-
GMAT3	4.609.167,11	840.562,50	175.767,14	0,64%	(757.078,97)	(3.223,18)	1.272.715,26
GNDI3	13.038.102,82	2.154.580,65	581.440,28	2,11%	5.381.718,90	17.576,58	(4.885.748,36)
GOAU4	449.271,63	57.131,73	(6.851,41)	-0,02%	(32.407,84)	(131,12)	48.114,13
GOLL4	131.124,84	31.788,18	21.029,41	0,08%	32.864,64	114,38	(34.365,32)
HAPV3	16.571.243,83	3.285.682,69	931.562,02	3,38%	8.020.685,36	25.522,64	(6.879.791,01)
HBSA3	273.447,78	31.215,33	21.021,35	0,08%	131.118,79	417,91	(112.862,95)
HYPE3	2.769.886,78	349.141,44	120.908,02	0,44%	963.028,57	3.224,06	(923.309,14)
IFCM3	3.585.300,00	487.851,47	139.951,58	0,51%	-	-	-
IGTA3	666.434,46	68.925,64	25.560,39	0,09%	105.619,56	382,34	(120.755,68)
INTB3	5.278.449,68	908.301,92	523.466,01	1,90%	-	-	-
IRBR3	303.382,03	24.498,30	1.659,96	0,01%	31.692,39	117,54	(38.317,61)
ITSA4	15.788.157,00	929.069,54	745.296,29	2,70%	1.142.476,79	4.300,93	(1.429.956,11)
ITUB4	34.830.711,10	5.570.447,47	2.625.040,33	9,52%	16.261.900,04	52.066,64	(14.136.573,74)
JBSS3	20.265.075,61	1.919.256,77	469.953,51	1,70%	(5.053.144,20)	(22.647,91)	9.658.806,55
JHSF3	78.916,85	7.339,73	5.282,72	0,02%	22.132,37	76,10	(22.517,52)
KLBN11	961.805,38	88.410,30	(14.641,81)	-0,05%	129.064,76	472,28	(151.265,00)
LAME4	4.638.987,99	2.915.608,76	(557.334,64)	-2,02%	1.365.246,17	4.667,92	(1.371.756,84)
LCAM3	561.870,94	87.706,38	58.596,33	0,21%	172.175,37	585,84	(171.132,42)
LREN3	13.512.137,43	824.741,15	544.890,20	1,98%	3.062.999,80	10.767,46	(3.275.795,86)
LWSA3	4.551.319,80	471.688,21	340.960,56	1,24%	1.324.378,96	4.534,22	(1.334.658,48)
MATD3	1.989.816,12	102.157,94	28.948,88	0,10%	-	-	-
MDNE3	49.543,00	10.154,04	7.428,11	0,03%	34.944,86	103,20	(25.556,15)
MGLU3	6.112.179,39	1.031.186,97	587.791,30	2,13%	5.148.651,96	14.578,17	(3.447.903,71)
MOVI3	7.623.990,00	1.009.529,56	734.452,97	2,66%	2.391.196,96	8.112,91	(2.361.583,40)
MRFG3	477.662,50	72.038,56	19.148,65	0,07%	(158.876,04)	(752,47)	349.846,48
MRVE3	211.241,80	34.497,59	17.238,47	0,06%	99.622,77	318,42	(86.282,57)
MULT3	2.075.480,84	174.952,51	84.291,61	0,31%	410.283,40	1.460,13	(451.200,65)
NTCO3	21.271.998,20	2.058.552,32	855.874,16	3,10%	8.679.797,52	28.398,14	(7.910.471,01)
OMGE3	3.623.407,38	319.980,94	(22.697,18)	-0,08%	435.477,05	1.603,61	(517.863,38)
PACUCAR_CBD ON ED	206.767,47	35.732,90	1.455,32	0,01%	28.475,41	104,03	(33.252,36)
PARD3	592.590,60	106.491,67	19.927,83	0,07%	124.786,15	441,66	(135.527,37)
PETR3	29.133.355,63	3.529.372,88	719.007,63	2,61%	(3.745.470,44)	(15.625,87)	5.990.624,61
PETR4	34.950.686,51	4.351.209,77	631.873,38	2,29%	(4.981.921,99)	(20.948,22)	8.123.027,24
PETZ3	3.356.432,63	919.279,14	466.110,32	1,69%	1.970.536,09	6.049,72	(1.564.672,76)
POWE3	73.160,00	10.616,50	3.289,73	0,01%	-	-	-
PRIO3	13.643.204,88	3.937.206,99	333.394,66	1,21%	(6.049.776,52)	(31.131,64)	16.606.905,21
QUAL3	446.913,20	67.398,99	9.922,20	0,04%	192.464,03	624,43	(172.207,15)
RADL3	7.300.825,50	1.025.438,08	123.045,87	0,45%	2.260.987,52	7.683,18	(2.240.806,80)
RAIL3	9.382.995,96	690.547,29	461.834,33	1,68%	1.738.551,58	6.220,31	(1.935.288,79)
RAPT4	4.170.680,00	462.358,40	261.673,05	0,95%	530.667,48	1.947,92	(626.440,28)
RDOR3	974.916,00	116.473,66	51.326,48	0,19%	169.531,27	-	-
RECV3	820.380,00	243.644,74	132.847,91	0,48%	-	-	-
RENT3	5.524.697,40	797.173,82	516.985,33	1,88%	1.561.587,33	5.364,34	(1.585.590,25)
SANB11	541.456,00	50.211,06	12.170,56	0,04%	74.947,51	273,73	(87.457,38)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	694.068.854,55	VAR / PL:	3,972%
VAR:	27.571.515,45	ETL / PL:	4,9816%
ETL:	34.575.804,57	VAR / CDI:	13578,10%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.236,85)	BAIXA 1:	1.446,38	Cenário 1:	110.876.263,77
				Cenário 2:	339.234,36
				Cenário 3:	(81.698.917,98)

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
SBSP3	617.091,20	66.370,23	42.519,56	0,15%	(11.259,23)	(44,30)	15.636,27
SEER3	423.874,44	70.684,69	16.563,16	0,06%	75.532,31	271,08	(84.670,97)
SOMA3	2.182.931,84	489.234,58	318.745,32	1,16%	656.008,91	2.237,38	(655.478,83)
STBP3	7.208.455,00	1.976.981,46	1.351.256,65	4,90%	3.271.403,26	10.523,94	(2.873.314,70)
SULA11	3.039.113,28	240.499,75	(44.806,29)	-0,16%	696.759,55	2.446,69	(743.344,59)
SUZB3	16.669.622,61	2.522.401,99	478.053,62	1,73%	6.255.688,98	20.721,88	(5.858.558,20)
SYNE3	283.433,00	47.273,25	(22.869,01)	-0,08%	-	-	-
TAAE11	413.708,10	23.564,45	3.023,81	0,01%	22.607,66	85,82	(28.855,77)
TEND3	1.711.118,00	147.317,44	(3.438,36)	-0,01%	514.723,43	1.755,31	(514.172,64)
TIMS3	2.677.653,00	171.969,23	141.280,74	0,51%	205.228,36	771,05	(255.670,26)
TOTS3	10.199.629,44	1.494.280,38	658.601,61	2,39%	3.274.936,84	11.078,63	(3.213.249,45)
UGPA1	399,45	127,61	(17,38)	0,00%	-	-	-
UGPA3	7.793.968,95	1.157.145,63	596.921,92	2,16%	1.065.191,30	3.893,47	(1.245.227,51)
USIM5	7.259.171,50	1.204.490,76	720.279,63	2,61%	1.086.545,11	3.948,58	(1.253.388,83)
VALE3	60.724.993,58	6.293.346,98	831.103,80	3,01%	14.306.492,31	50.104,82	(15.171.972,31)
VBBR3	4.683.050,70	452.627,76	342.632,27	1,24%	-	-	-
VIIA3	505.769,85	95.883,83	57.292,88	0,21%	-	-	-
VITT3	249.795,60	3.072.782,22	487.056,91	1,77%	-	-	-
VIVT3	1.044.183,28	90.814,65	8.396,59	0,03%	(88.052,97)	(358,57)	132.793,05
WEGE3	14.862.086,00	1.572.599,18	745.651,04	2,70%	(254.003,78)	(998,80)	352.258,85
WEST3	40.356,00	51.281,46	13.014,10	0,05%	-	-	-
YDUQ3	924.786,38	151.368,89	80.847,14	0,29%	147.421,65	533,44	(168.390,81)
INDZ21	939.213,00	38.373,53	33.326,46	0,12%	-	-	-
COMPROMISSADA	21.163.359,70	439,96	245,92	0,00%	984,00	(511,72)	(1.518,83)
EMP AÇÃO PROVISÃO	4.568,12	1,68	1,13	0,00%	3,41	(1,77)	(5,25)
LFT	299.195,44	37,35	8,22	0,00%	0,01	-	(0,01)
Total	697.697.892,40	90.151.359,95	27.571.515,45	100,00%	110.876.263,77	339.234,36	(81.698.917,98)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIR F EMB II CNPJ - 11005764000196

Dados Gerais

PL:	1.806.166.483,65	VAR / PL:	4,293%
VAR:	77.543.478,16	ETL / PL:	5,3839%
ETL:	97.242.683,34	VAR / CDI:	14674,67%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(164.174.227,92)	BAIXA 1:	207.435.672,26	Cenário 1:	129.464.830,00
				Cenário 2:	(62.406.068,54)
				Cenário 3:	(232.590.111,33)

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	5.000,00	22,97	19,76	0,00%	(172,65)	(0,68)	244,56
RECEBER	(50.265,86)	230,90	(198,65)	0,00%	1.735,70	6,89	(2.458,56)
COMPROMISSADA	100.564.451,55	462.815,69	398.578,77	0,51%	(3.467.857,83)	(16.208,14)	4.911.508,29
GASP17	31.351.460,89	735.567,22	708.352,87	0,91%	164.543,65	(15.825,35)	(923.221,15)
CSMGC3	12.803.420,59	302.530,39	285.169,21	0,37%	(211.731,94)	(83.689,25)	149.153,99
DE252 PETR IPCA - PETR45	13.695.463,91	337.445,33	317.359,46	0,41%	(227.277,71)	(89.421,80)	152.145,86
SBESC7	9.894.455,69	148.138,10	134.591,30	0,17%	(295.504,13)	(18.057,91)	383.925,21
SBSPC2	7.823.462,22	190.458,45	178.906,66	0,23%	(116.113,09)	(55.700,44)	62.899,37
ELET42	11.646.245,45	337.042,80	329.412,36	0,42%	59.904,20	(157.763,02)	(328.159,75)
ENTV12	11.283.072,02	328.749,50	320.920,62	0,41%	84.424,51	(169.420,77)	(330.326,35)
IGSN15	2.206.496,94	69.565,14	68.214,85	0,09%	27.448,17	(35.371,26)	(82.807,33)
NEOE16	5.753.552,92	174.395,29	170.921,62	0,22%	38.809,60	(79.242,07)	(188.559,24)
LFS0120016V	5.061.115,35	99.460,30	92.110,63	0,12%	(144.286,78)	(11.769,29)	180.827,62
LFS012001GU	792.508,21	16.756,25	15.430,97	0,02%	(20.316,20)	(2.664,65)	23.413,62
LFS012001GZ	3.962.541,05	83.781,24	77.154,87	0,10%	(101.581,02)	(13.323,23)	117.068,11
LFS012001H2	9.510.098,52	201.074,99	185.171,68	0,24%	(243.794,44)	(31.975,76)	280.963,46
LFS012001H4	7.132.573,89	150.806,24	138.878,76	0,18%	(182.845,83)	(23.981,82)	210.722,60
LFS012001H6	5.547.557,47	117.293,74	108.016,81	0,14%	(142.213,42)	(18.652,53)	163.895,35
NTNB	1.641.742.280,85	74.019.803,84	74.014.465,61	95,45%	134.241.659,21	(61.583.007,46)	(237.371.346,99)
Total	1.880.725.491,68	77.775.938,36	77.543.478,16	100,00%	129.464.830,00	(62.406.068,54)	(232.590.111,33)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FI RF EMB V CREDITO PRIVADO CNPJ - 20726178000121

Dados Gerais

PL:	178.365.760,87	VAR / PL:	1,551%
VAR:	2.766.360,91	ETL / PL:	1,9450%
ETL:	3.469.129,37	VAR / CDI:	5301,25%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(4.267.620,27)	BAIXA 1:	2.999.287,37	Cenário 1:	2.894.104,70
				Cenário 2:	(945.263,34)
				Cenário 3:	(5.860.797,17)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(26.344,00)	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	787.770,06	16,38	9,61	0,00%	36,63	(19,05)	(56,54)
CMTR33	5.341.972,78	49.987,10	35.742,17	1,29%	(1.540,57)	566,23	3.463,20
17H0164854	7.893.812,58	161.549,68	161.388,21	5,83%	177.947,52	(62.511,84)	(356.500,66)
AEGP23	11.665.768,54	266.264,06	265.393,06	9,59%	278.808,36	(99.457,55)	(572.150,29)
CCRDD1	4.943.559,01	100.079,43	99.776,99	3,61%	90.525,16	(32.103,74)	(188.443,57)
CMDT33	2.520.881,88	43.813,05	43.548,19	1,57%	34.797,77	(12.502,43)	(74.163,06)
100 - GASP17	6.486.509,15	128.795,79	119.466,40	4,32%	258.025,45	(2.385,61)	(508.274,06)
GEPA24	13.848.224,05	233.043,03	230.007,45	8,31%	129.657,67	(46.925,01)	(281.075,41)
ERDV17	10.192.354,34	228.826,49	228.157,72	8,25%	234.887,88	(84.000,40)	(481.615,14)
ERDV36	3.295.706,01	66.719,62	66.518,00	2,40%	60.350,11	(21.402,49)	(125.629,05)
ECPT11	3.016.099,42	27.658,72	25.185,56	0,91%	8.873,03	(3.207,60)	(19.181,71)
ECPT21	455.775,31	5.530,09	4.883,83	0,18%	528,07	(193,27)	(1.175,23)
ECPT31	599.374,49	8.777,93	8.246,88	0,30%	2.721,63	(990,53)	(5.977,85)
ECPT41	986.086,71	16.515,08	15.836,97	0,57%	8.090,77	(2.935,21)	(17.637,98)
SULM23	1.114.085,10	13.686,39	12.280,83	0,44%	2.125,30	(776,72)	(4.686,88)
RDCO34	8.267.936,59	95.935,73	94.461,81	3,41%	58.938,13	(24.331,20)	(113.880,93)
SBESC7	230.103,62	2.517,85	2.408,82	0,09%	1.073,39	(388,43)	(2.326,15)
SBSPC2	5.995.593,12	124.436,82	123.898,71	4,48%	118.045,90	(41.865,27)	(245.047,91)
TAE33	10.999.294,15	223.040,65	222.477,59	8,04%	181.860,09	(65.463,28)	(389.299,95)
ENMI21	995.440,14	21.901,67	21.837,40	0,79%	25.540,44	(9.004,84)	(51.242,14)
ENTV12	14.832.538,43	377.662,39	373.268,75	13,49%	623.156,96	(220.685,78)	(1.159.718,40)
ENJG21	1.649.797,41	35.438,39	35.351,69	1,28%	40.224,79	(14.190,63)	(80.875,49)
ECCR32	3.226.854,13	54.043,67	51.824,65	1,87%	26.476,11	(9.605,12)	(57.718,25)
LFS012001IP	7.937.164,03	136.636,81	132.119,43	4,78%	71.894,12	(26.065,63)	(156.498,73)
LFSN16000GM	11.660.409,40	296.751,44	294.091,80	10,63%	335.521,35	(120.040,66)	(708.043,22)
D - LFSN1800DC5	3.760.841,58	99.360,89	98.178,37	3,55%	125.538,63	(44.777,28)	(263.041,79)
Total	142.678.608,05	2.818.989,17	2.766.360,91	100,00%	2.894.104,70	(945.263,34)	(5.860.797,17)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIM EMB I A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	221.445.713,80	VAR / PL:	0,829%
VAR:	1.836.090,90	ETL / PL:	1,0398%
ETL:	2.302.532,85	VAR / CDI:	2834,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(617.838,23)	BAIXA 1:	1.013.243,90	Cenário 1:	(471.335,64)
				Cenário 2:	(550.664,44)
				Cenário 3:	2.055.939,43

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	9,76	8,35	0,00%	(99,11)	(0,39)	136,45
RECEBER	(8.238,27)	8,93	(7,64)	0,00%	90,72	0,36	(124,90)
AMER3	469.883,70	114.118,71	(68.620,02)	-3,74%	(5.174,34)	(20,28)	7.123,87
BRIT3	184.688,00	34.526,91	28.588,92	1,56%	(2.033,78)	(7,97)	2.800,04
CASH3	159.542,00	87.343,05	71.912,61	3,92%	181.892,76	(6,89)	(100.782,60)
CBAV3	259.231,00	35.810,67	19.886,26	1,08%	(2.854,64)	(11,19)	3.930,18
CSAN3	526.414,00	69.017,18	47.213,12	2,57%	42.649,43	157,99	(51.375,84)
CURY3	64.704,00	7.461,10	2.434,03	0,13%	14.239,36	49,67	(14.943,16)
ENEV3	383.040,00	46.773,96	39.484,36	2,15%	76.010,34	267,55	(81.421,51)
EQTL3	517.088,00	49.170,71	43.286,38	2,36%	64.088,46	232,94	(73.881,93)
HAPV3	776.642,00	154.743,41	122.612,68	6,68%	367.351,91	1.162,64	(310.659,53)
LAME4	224.962,08	141.168,56	(93.520,49)	-5,09%	63.728,68	216,65	(63.111,05)
LJQZ3	150.540,00	30.328,94	29.426,33	1,60%	121.476,44	344,71	(81.437,70)
LREN3	1.031.360,00	63.007,74	24.745,71	1,35%	222.436,62	777,34	(234.399,93)
MGLU3	578.626,87	98.137,19	77.327,78	4,21%	481.039,99	1.355,11	(317.633,11)
MRVE3	159.355,00	26.132,17	21.407,72	1,17%	73.397,87	233,33	(62.673,23)
MULT3	196.312,00	16.551,58	4.647,22	0,25%	36.645,40	129,63	(39.701,12)
NTCO3	1.081.420,00	105.659,59	85.788,53	4,67%	429.352,61	1.397,01	(385.755,03)
ONCO3	182.520,00	54.699,48	48.009,83	2,61%	(2.009,90)	(7,88)	2.767,17
PETZ3	328.475,00	90.293,21	80.554,66	4,39%	189.228,02	577,87	(148.145,65)
RADL3	378.975,00	53.565,11	32.056,80	1,75%	113.191,24	382,46	(110.571,34)
RAIZ4	360.696,00	29.705,29	25.010,53	1,36%	(3.971,97)	(15,57)	5.468,48
RDR3	312.700,00	37.657,91	31.062,16	1,69%	50.932,97	(13,50)	4.740,82
RENT3	267.270,00	38.736,15	33.394,84	1,82%	72.602,23	247,97	(72.654,53)
SMFT3	159.343,00	33.827,50	29.831,15	1,62%	(1.754,68)	(6,88)	2.415,79
SQIA3	124.027,00	25.435,25	20.602,64	1,12%	63.774,25	198,93	(52.260,60)
SUZB3	300.303,00	45.619,05	15.174,43	0,83%	109.389,22	360,34	(100.989,97)
UGPA1	16,06	5,13	(0,42)	0,00%	(0,18)	(0,00)	0,24
UGPA3	292.320,00	43.321,74	8.122,01	0,44%	36.731,97	133,41	(42.271,57)
VALE3	286.440,00	29.561,02	(12.373,82)	-0,67%	64.329,51	223,98	(67.223,55)
DI1F22	123.456.314,56	268.783,98	260.605,93	14,19%	(1.084.107,58)	(148.192,39)	1.448.377,22
DI1J22	41.113.338,63	216.641,70	203.733,61	11,10%	(191.667,19)	(136.556,29)	225.216,32
DI1N22	(2.235.880,98)	22.049,09	(20.224,18)	-1,10%	(248,45)	12.874,43	3.723,62
DI1F23	20.289.992,36	394.135,95	359.554,83	19,58%	204.441,30	(218.891,59)	(330.753,56)
COMPROMISSADA	178.106.485,14	194.930,16	167.559,30	9,13%	(1.953.019,98)	(11.995,22)	2.687.475,61
DE252 AERIS CDI - AER11	1.267.935,83	2.554,95	2.508,82	0,14%	(11.775,91)	(1.153,86)	16.032,93
ANHB10	916.126,02	1.229,69	1.176,35	0,06%	(9.491,79)	(338,50)	13.023,30
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.711.323,19	2.115,03	1.969,40	0,11%	(18.202,11)	(400,32)	24.991,42
DE252 BCBF CDI - BCBF14	268.725,90	481,75	472,83	0,03%	(2.600,84)	(192,15)	3.549,31
CGBP13	2.381.284,71	6.068,46	5.830,62	0,32%	(18.762,13)	(3.763,52)	25.640,49
ELET13	2.066.548,92	4.259,11	4.171,77	0,23%	(18.682,27)	(2.122,18)	25.458,82
ETEN13	2.852.087,73	61.577,27	51.130,60	2,78%	79.167,65	(53.186,30)	(106.336,65)
DE252 EQUATENE CDI -	1.449.883,48	2.017,18	1.934,89	0,11%	(15.023,49)	(539,06)	20.593,57
GRRB14	1.076.308,03	1.514,54	1.462,76	0,08%	(10.977,31)	(483,59)	15.054,13
IVIA35	1.338.496,07	1.903,08	1.833,42	0,10%	(13.769,77)	(546,80)	18.870,46
LORTA1	613.859,03	573,16	448,06	0,02%	(6.941,73)	67,95	9.586,65
MOVI33	1.434.520,56	1.490,19	1.267,76	0,07%	(15.796,85)	(61,93)	21.748,61
OMGE13	1.100.597,40	2.881,72	2.760,60	0,15%	(8.507,33)	(1.819,42)	11.623,43
PRLG14	3.241.797,98	47.100,51	(39.999,34)	-2,18%	(101.670,26)	33.071,68	145.626,05
CBAN22	1.108.137,66	2.285,77	2.237,81	0,12%	(9.975,78)	(1.156,41)	13.603,06
SULM15	654.529,65	673,86	(123,28)	-0,01%	(8.073,78)	417,54	11.237,37



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIM EMB I A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	221.445.713,80	VAR / PL:	0,829%
VAR:	1.836.090,90	ETL / PL:	1,0398%
ETL:	2.302.532,85	VAR / CDI:	2834,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(617.838,23)	BAIXA 1:	1.013.243,90	Cenário 1:	(471.335,64)
				Cenário 2:	(550.664,44)
				Cenário 3:	2.055.939,43

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
VIVT15	2.123.408,87	25.385,30	23.670,29	1,29%	14,72	(12.322,17)	(4.166,06)
VAMO22	1.098.547,55	2.107,32	2.068,93	0,11%	(10.267,61)	(962,95)	14.005,50
LF selic	3.002.407,60	3.118,92	2.653,39	0,14%	(33.062,32)	(129,61)	45.519,17
LF0021006S0	1.008.423,71	1.047,56	891,20	0,05%	(11.104,70)	(43,53)	15.288,60
LF002100HDP	1.200.969,36	1.247,57	1.061,36	0,06%	(13.225,00)	(51,84)	18.207,76
LF002100HDQ	2.187.853,12	2.272,76	1.933,52	0,11%	(24.092,50)	(94,45)	33.169,80
LF002100ISJ	2.242.991,08	2.330,03	1.982,25	0,11%	(24.699,68)	(96,83)	34.005,74
NTNB	2.354.694,43	25.632,13	23.450,72	1,28%	4.105,69	(10.354,48)	(21.799,43)
Total	409.189.363,03	2.860.805,77	1.836.090,90	100,00%	(471.335,64)	(550.664,44)	2.055.939,43



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIM EMB II A CNPJ - 20725957000102

Dados Gerais

PL:	213.929.320,45	VAR / PL:	0,897%
VAR:	1.918.617,26	ETL / PL:	1,1247%
ETL:	2.406.024,28	VAR / CDI:	3065,48%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(3.731.961,75)	BAIXA 1:	5.035.221,42	Cenário 1:	4.171.957,97
				Cenário 2:	(1.387.747,81)
				Cenário 3:	(6.565.236,94)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(23.578,93)	-	-	0,00%	-	-	-
WSPZ21	3.253.542,19	206.637,61	(147.477,03)	-7,69%	(369.687,72)	(29.281,88)	579.466,31
INDZ21	8.139.846,00	332.570,61	141.980,94	7,40%	-	-	-
WINZ21	313.071,00	12.791,18	5.460,81	0,28%	-	-	-
DI1F22	2.465.182,00	3.060,20	2.585,35	0,13%	5.498,96	(2.852,69)	(8.453,15)
DI1J22	1.344.828,83	6.157,65	5.655,71	0,29%	8.539,71	(4.408,74)	(13.021,95)
DI1N22	745.293,66	6.853,69	6.303,34	0,33%	8.289,96	(4.259,30)	(12.540,54)
DI1V22	901.710,06	13.073,66	12.005,77	0,63%	14.683,19	(7.510,27)	(22.046,51)
DI1F23	(33.408.521,91)	626.557,46	(577.295,11)	-30,09%	(704.516,42)	358.974,12	1.051.106,71
DI1N23	1.566.473,17	39.677,14	36.928,75	1,92%	47.796,78	(24.180,22)	(70.467,65)
DI1F24	3.507.848,14	102.310,74	96.427,00	5,03%	139.395,85	(70.040,99)	(203.204,74)
DI1N24	810.339,01	26.081,18	24.748,49	1,29%	39.595,74	(19.764,97)	(57.095,83)
DI1F25	1.597.412,66	56.407,14	53.479,48	2,79%	93.392,49	(46.300,63)	(133.153,23)
DI1F27	1.486.165,04	75.700,26	70.626,70	3,68%	145.280,23	(70.035,00)	(197.792,55)
DI1F29	2.405.119,39	150.792,01	137.047,53	7,14%	331.757,83	(155.567,36)	(431.681,70)
DI1F31	241.978,08	17.742,61	15.643,32	0,82%	43.654,80	(19.903,48)	(54.265,93)
AUSZ21	843.764,85	46.073,29	(19.027,42)	-0,99%	(10.905,26)	7.666,07	15.048,26
EUPZ21	(1.304.378,89)	26.692,38	2.901,22	0,15%	(56.545,56)	(11.846,02)	73.092,98
NZLZ21	802.567,00	39.879,32	(14.610,34)	-0,76%	7.608,86	7.292,89	(10.225,34)
SWIZ21	1.132.505,05	43.803,06	11.483,30	0,60%	(13.740,56)	(10.186,90)	18.943,06
WDOZ21	(56.738,48)	2.438,33	789,80	0,04%	6.496,19	482,01	(10.206,39)
COMPROMISSADA	61.004.194,84	1.268,19	801,52	0,04%	2.836,42	(1.475,06)	(4.378,10)
AEGP13	1.061.924,47	93,94	85,22	0,00%	152,62	(78,09)	(229,37)
CPGT14	296.436,61	1.229,04	(1.140,07)	-0,06%	(1.460,59)	747,94	2.197,38
CPGT16	294.615,24	621,70	(585,77)	-0,03%	(841,47)	425,51	1.239,77
ERDV18	1.772.956,51	25.215,32	23.247,33	1,21%	51.871,12	(24.576,35)	(68.648,49)
ESUL18	994.986,31	1.049,09	(957,98)	-0,05%	(1.133,78)	587,61	1.740,09
LORTA1	542.242,14	113,36	(93,43)	0,00%	(160,71)	83,43	247,32
VIVT15	2.869.471,45	32.276,12	29.572,17	1,54%	31.618,40	(16.527,71)	(49.133,63)
LF selic	3.726.246,14	4.028,26	(3.811,19)	-0,20%	(5.674,45)	2.954,64	8.777,05
LFT	37.702.387,54	26.929,40	(12.372,25)	-0,64%	0,79	0,00	(1,07)
NTNB	106.916.129,14	2.085.766,79	2.018.202,23	105,19%	3.658.587,86	(1.248.165,87)	(6.970.549,96)
IDIFQG0	(43,50)	69,77	(50,63)	0,00%	(91.164,75)	24,06	42,39
IDIFQG1	43,50	70,65	51,28	0,00%	97.663,47	(24,25)	(42,38)
IDIFQG7	60,00	105,52	76,58	0,00%	208.507,62	(35,10)	(58,33)
IDIFQG8	(120,00)	214,01	(155,32)	-0,01%	(450.355,54)	70,79	116,61
IDIFQG9	60,00	108,53	78,77	0,00%	243.475,45	(35,69)	(58,28)
IDIFQHM	(70,00)	346,28	(251,29)	-0,01%	(12.762.624,28)	60,33	64,64
IDIFQHN	70,00	361,70	262,48	0,01%	13.454.064,73	(60,64)	(64,41)
Total	213.955.018,32	4.015.167,20	1.918.617,26	100,00%	4.171.957,97	(1.387.747,81)	(6.565.236,94)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIM EMB III A IMOBILIÁRIO CNPJ - 32711990000162

Dados Gerais

PL:	85.767.209,11	VAR / PL:	1,020%
VAR:	875.058,75	ETL / PL:	1,2795%
ETL:	1.097.359,35	VAR / CDI:	3487,36%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(16,83)	BAIXA 1:	17,21	Cenário 1:	2.696.659,59
				Cenário 2:	9.183,74
				Cenário 3:	(3.461.965,02)

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	19,14	6,18	0,00%	16,53	0,06	(22,04)
RECEBER	(181.632,93)	3.476,27	(1.123,04)	-0,13%	(3.002,83)	(11,61)	4.002,42
AIEC11	945.350,00	68.699,91	36.913,96	4,22%	89.238,01	60,44	(112.410,76)
BLCP11	1.526.877,30	29.222,91	9.440,69	1,08%	25.242,96	97,61	(33.645,93)
BMLC11	1.756.924,80	33.625,79	10.863,07	1,24%	29.046,20	112,32	(38.715,20)
BPML11	1.298.129,83	73.759,11	10.394,23	1,19%	129.168,41	486,45	(161.865,46)
CBOP11	31.679,88	1.636,74	(953,57)	-0,11%	3.054,73	11,52	(3.840,02)
CEOC11	884.740,00	37.273,15	(18.446,94)	-2,11%	67.755,00	257,73	(86.901,03)
CNES11	559.759,20	23.490,77	1.171,57	0,13%	30.136,39	115,72	(39.513,08)
GALG11	1.284.553,62	33.666,07	11.911,61	1,36%	53.783,26	82,12	(71.248,34)
GALG12	2.310,38	9.146,57	5.582,86	0,64%	38,20	0,15	(50,91)
HBRH11	2.385.752,80	45.660,93	14.751,12	1,69%	39.442,25	152,52	(52.571,91)
HSML11	7.170.191,40	195.168,75	30.392,71	3,47%	408.096,31	1.565,15	(533.548,05)
JRDM11	1.093.306,50	34.475,47	3.891,27	0,44%	39.032,91	150,83	(51.941,18)
LVBI11	3.838.954,00	121.029,50	84.618,74	9,67%	228.055,69	873,77	(297.462,40)
MALL11	7.308.379,50	175.068,25	32.031,61	3,66%	311.550,13	1.201,29	(412.471,06)
MAXR11	1.461.105,30	61.538,51	13.934,79	1,59%	54.265,33	209,61	(72.140,63)
NEWU11	600.237,00	11.487,94	3.711,27	0,42%	9.923,36	38,37	(13.226,69)
PATC11	8.086.496,25	208.673,94	44.800,23	5,12%	146.858,16	568,26	(196.053,09)
PVBI11	2.310.617,40	139.590,52	(85.355,74)	-9,75%	159.835,56	147,72	(206.515,96)
QAGR11	8.335.281,05	182.103,22	(3.382,17)	-0,39%	24.871,92	532,87	(27.723,39)
RBGS11	546.171,60	59.814,84	35.186,13	4,02%	123.520,51	440,30	(136.495,54)
RBRL11	1.823.645,52	154.142,06	91.436,80	10,45%	30.149,26	116,58	(40.185,44)
RCRB11	1.704.868,26	62.565,83	19.486,82	2,23%	(29.030,35)	(117,89)	43.380,19
RNGO11	150.561,42	6.655,71	3.346,16	0,38%	626,78	2,32	(749,53)
SDIL11	356.663,06	16.782,65	11.796,48	1,35%	22.274,08	85,23	(28.968,50)
TEPP11	7.573.549,09	436.714,98	317.869,12	36,33%	149.501,25	578,73	(199.775,26)
TRXF11	13.233.500,00	213.774,13	138.785,44	15,86%	167.061,84	643,98	(221.003,03)
VISC11	6.606,60	322,38	1,78	0,00%	(79,47)	(0,32)	119,76
VVPR11	1.302.160,00	24.922,04	8.051,26	0,92%	21.527,84	83,25	(28.694,11)
XPIN11	1.834.272,00	35.836,28	(1.157,45)	-0,13%	147.783,48	117,26	(188.786,63)
XPIN13	294.229,80	5.631,26	1.819,22	0,21%	4.864,33	18,81	(6.483,58)
XPIN14	2.842.600,00	54.404,53	17.575,81	2,01%	46.995,03	181,73	(62.638,90)
XPPR11	3.406.143,60	110.253,61	13.036,35	1,49%	91.285,65	217,75	(122.013,97)
COMPROMISSADA	664.240,54	12.708,56	4.107,02	0,47%	11.012,38	26,40	(14.684,73)
FII HSI LOGISTICA	444.013,50	16.540,06	(1.913,01)	-0,22%	34.746,41	28,39	(9.784,18)
FII VIA PQ SHOPPING	1.694.375,94	32.428,66	10.476,33	1,20%	28.012,12	108,32	(37.336,89)
Total	88.577.614,22	2.732.311,04	875.058,75	100,00%	2.696.659,59	9.183,74	(3.461.965,02)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	450.538.519,56	VAR / PL:	3,878%
VAR:	17.471.589,42	ETL / PL:	4,8631%
ETL:	21.910.085,51	VAR / CDI:	13255,05%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(310,67)	BAIXA 1:	317,78	Cenário 1:	72.036.246,94
				Cenário 2:	221.312,11
				Cenário 3:	(53.325.565,28)

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%	-	-	-
RECEBER	1.506.530,50	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	21.432.969,95	1.945.738,71	(81.383,35)	-0,47%	2.820.663,13	10.333,49	(3.314.687,40)
AMER3	905.850,00	220.748,40	27.919,16	0,16%	-	-	-
ASAI3	4.478.441,00	974.262,72	209.484,72	1,20%	-	-	-
B3SA3	19.801.911,39	1.464.679,75	497.834,35	2,85%	4.921.376,57	17.143,47	(5.156.200,36)
UNT	12.912.130,00	1.261.462,57	839.421,75	4,80%	4.680.164,35	15.579,22	(4.430.792,48)
BBAS3	12.753.750,00	1.172.246,40	590.370,42	3,38%	(101.512,36)	(397,34)	139.251,67
BBDC4	26.677.760,90	3.073.820,81	973.884,83	5,57%	2.288.421,67	8.561,05	(2.822.742,09)
BIDI11	1.934.750,00	545.833,91	246.442,39	1,41%	2.548.602,07	6.349,41	(1.317.221,99)
BPAN4	3.014.172,00	334.928,28	299.028,92	1,71%	1.321.124,04	4.274,18	(1.174.820,00)
CESP6	6.076.650,00	383.178,28	(123.182,49)	-0,71%	(171.652,15)	(678,81)	241.282,94
CIEL3	2.719.104,00	478.190,77	133.800,46	0,77%	539.702,10	1.920,05	(593.061,58)
CPFE3	5.275.155,00	608.865,74	23.323,75	0,13%	691.264,97	2.533,09	(812.809,21)
CSED3	2.468.548,00	375.401,00	248.711,29	1,42%	-	-	-
EGIE3	4.747.020,00	243.491,97	(47.303,02)	-0,27%	124.946,74	480,85	(164.669,97)
ELET6	4.527.792,00	488.362,70	292.366,18	1,67%	477.906,24	1.771,62	(577.146,13)
ENAT3	2.125.314,00	517.425,09	166.602,55	0,95%	(299.384,48)	(1.257,67)	487.013,75
ENEV3	2.568.960,00	311.646,58	76.538,49	0,44%	538.072,91	1.905,32	(585.022,87)
GGBR4	7.540.070,00	978.857,94	208.952,68	1,20%	(364.658,79)	(1.457,07)	525.416,08
GNDI3	7.213.832,00	1.192.104,64	87.670,97	0,50%	2.977.643,03	9.724,92	(2.703.228,25)
HAPV3	13.656.436,00	2.707.745,77	232.370,92	1,33%	6.609.882,60	21.033,32	(5.669.666,47)
IFCM3	3.585.300,00	487.851,47	101.031,81	0,58%	-	-	-
INTB3	4.229.624,00	727.822,72	295.360,22	1,69%	-	-	-
ITSA4	11.753.675,00	691.656,50	561.233,83	3,21%	850.529,98	3.201,88	(1.064.547,27)
ITUB4	28.546.288,47	4.565.384,84	1.601.551,23	9,17%	13.327.803,97	42.672,38	(11.585.945,26)
JBSS3	17.552.975,00	1.662.400,22	554.889,94	3,18%	(4.376.875,54)	(19.616,91)	8.366.156,29
LAME4	4.426.695,00	2.782.182,39	(249.683,93)	-1,43%	1.302.768,71	4.454,30	(1.308.981,43)
LRN3	10.081.544,00	615.347,81	409.969,84	2,35%	2.285.335,49	8.033,71	(2.444.104,81)
LWSA3	4.144.950,00	429.572,99	266.784,58	1,53%	1.206.130,27	4.129,38	(1.215.491,97)
MGLU3	4.541.281,00	766.160,40	344.045,30	1,97%	3.825.390,88	10.831,42	(2.561.753,94)
MOVI3	7.623.990,00	1.009.529,56	616.960,66	3,53%	2.391.196,96	8.112,91	(2.361.583,40)
NTCO3	9.837.810,00	952.033,11	237.060,16	1,36%	4.014.206,75	13.133,49	(3.658.410,93)
PETR3	21.502.357,00	2.604.912,28	1.013.812,19	5,80%	(2.764.406,67)	(11.532,93)	4.421.479,99
PETR4	25.676.557,75	3.196.620,73	1.048.392,17	6,00%	(3.659.974,11)	(15.389,63)	5.967.590,31
PETZ3	3.106.435,00	850.808,34	296.746,89	1,70%	1.823.764,38	5.599,12	(1.448.131,02)
PRI03	7.726.324,00	2.229.691,42	422.917,78	2,42%	(3.426.066,96)	(17.630,25)	9.404.705,96
RADL3	6.017.100,00	845.132,31	(44.055,79)	-0,25%	1.863.431,47	6.332,22	(1.846.799,19)
RAPT4	4.170.680,00	462.358,40	246.439,11	1,41%	530.667,48	1.947,92	(626.440,28)
STBP3	7.208.455,00	1.976.981,46	1.105.412,45	6,33%	3.271.403,26	10.523,94	(2.873.314,70)
SUZB3	10.766.601,00	1.629.172,80	187.367,39	1,07%	4.040.433,83	13.383,88	(3.783.934,41)
TIMS3	2.210.340,00	141.956,58	103.732,60	0,59%	169.411,22	636,48	(211.049,83)
TOTS3	9.322.939,08	1.365.842,26	360.329,44	2,06%	2.993.445,67	10.126,39	(2.937.060,51)
UGPA1	264,98	84,65	(10,03)	0,00%	-	-	-
UGPA3	4.504.860,00	668.822,15	366.878,42	2,10%	615.673,18	2.250,40	(719.732,86)
USIM5	6.570.675,00	1.090.250,77	767.448,97	4,39%	983.491,69	3.574,07	(1.134.511,10)
VALE3	48.264.781,95	5.002.009,91	1.579.500,67	9,04%	11.370.931,32	39.823,77	(12.058.822,77)
WEGE3	12.028.700,00	1.272.790,63	374.496,25	2,14%	(205.579,17)	(808,38)	285.102,38
COMPROMISSADA	12.264.306,23	254,96	122,27	0,00%	570,23	(296,55)	(880,17)
Total	452.012.656,20	57.306.623,70	17.471.589,42	100,00%	72.036.246,94	221.312,11	(53.325.565,28)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	68.922.951,86	VAR / PL:	5,179%
VAR:	3.569.591,80	ETL / PL:	6,4948%
ETL:	4.476.413,67	VAR / CDI:	17702,54%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(33,25)	BAIXA 1:	34,01	Cenário 1:	14.182.275,78
				Cenário 2:	47.336,78
				Cenário 3:	(13.582.990,41)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	893.970,42	-	-	0,00%	-	-	-
ALSO3	1.436.582,00	136.836,08	114.743,72	3,21%	487.054,07	1.636,07	(470.459,40)
AMER3	1.746.360,00	425.573,97	(101.245,45)	-2,84%	-	-	-
ASAI3	438.593,65	95.413,88	62.856,34	1,76%	-	-	-
B3SA3	2.273.333,16	168.150,69	65.326,48	1,83%	564.992,36	1.968,13	(591.951,00)
UNT	676.500,00	66.091,30	59.362,14	1,66%	245.205,96	816,24	(232.140,72)
BBDC4	837.790,00	96.530,45	(32.464,46)	-0,91%	71.865,73	268,85	(88.645,56)
BBRK3	19.182,00	3.212,96	2.065,77	0,06%	12.644,32	37,90	(9.541,88)
BBSÉ3	488.189,00	85.847,06	(49.838,67)	-1,40%	(79.725,03)	(339,23)	133.843,79
BID11	443.750,00	125.191,26	100.354,44	2,81%	584.541,76	1.456,29	(302.115,13)
BMGB4	135.115,00	14.510,76	9.059,13	0,25%	35.438,01	122,75	(36.658,81)
BRAP4	1.487.292,90	148.164,22	(16.390,54)	-0,46%	162.899,10	602,78	(195.899,50)
BRML3	3.505.534,89	362.665,06	300.042,02	8,41%	1.164.615,90	3.922,51	(1.131.608,35)
CESP6	1.320.339,00	83.257,26	(33.748,17)	-0,95%	(37.296,71)	(147,49)	52.426,14
CPPE3	1.907.475,00	220.163,42	120.754,87	3,38%	249.958,65	915,95	(293.908,57)
CRFB3	1.523.159,04	77.728,09	16.626,56	0,47%	136.008,72	507,98	(167.130,32)
CSED3	45.300,00	6.888,93	1.425,71	0,04%	-	-	-
CYRE3	766.932,79	136.648,60	118.863,69	3,33%	354.609,82	1.137,23	(309.360,70)
ELET3	778.090,00	82.119,47	32.284,23	0,90%	62.251,03	233,51	(77.268,14)
ELET6	1.654.776,00	178.482,33	97.946,55	2,74%	174.660,80	647,48	(210.930,09)
EQTL3	3.024.736,00	284.974,86	217.960,03	6,11%	408.197,38	1.493,18	(478.034,37)
ESPA3	13.678,00	5.826,77	4.155,95	0,12%	-	-	-
EUCATEX PN	77.212,00	8.038,26	5.418,30	0,15%	19.471,22	67,73	(20.331,14)
GGBR4	968.400,00	125.718,47	(51.657,24)	-1,45%	(46.834,52)	(187,14)	67.481,19
GNDI3	680.308,00	112.422,68	69.267,07	1,94%	280.809,75	917,12	(254.930,78)
HAPV3	974.899,20	193.299,28	121.410,66	3,40%	471.863,18	1.501,52	(404.743,47)
HBSA3	273.447,78	31.215,33	17.749,35	0,50%	131.118,79	417,91	(112.862,95)
HYPE3	2.172.405,20	273.829,49	162.621,71	4,56%	755.297,40	2.528,61	(724.145,69)
IGTA3	532.932,00	55.118,22	12.234,23	0,34%	84.461,49	305,75	(96.565,49)
ITSA4	1.648.200,00	96.989,94	58.675,87	1,64%	119.268,53	448,99	(149.279,85)
ITUB4	544.521,60	87.084,90	54.527,62	1,53%	254.228,40	813,98	(221.002,37)
LCAM3	230.841,00	36.033,59	31.517,93	0,88%	70.737,12	240,69	(70.308,64)
LREN3	1.953.041,31	119.207,90	70.073,67	1,96%	442.725,30	1.556,33	(473.482,80)
MDNE3	49.543,00	10.154,04	8.591,53	0,24%	34.944,86	103,20	(25.556,15)
MRVE3	56.840,00	9.282,46	7.421,06	0,21%	26.806,05	85,68	(23.216,53)
MULT3	762.283,20	64.256,61	30.415,61	0,85%	150.689,01	536,28	(165.717,11)
NTCO3	4.155.492,50	402.138,94	291.358,53	8,16%	1.695.601,57	5.547,59	(1.545.313,36)
OMGE3	1.309.101,81	115.606,00	19.085,32	0,53%	157.333,62	579,37	(187.099,00)
PARD3	592.590,60	106.491,67	51.740,03	1,45%	124.786,15	441,66	(135.527,37)
PETR3	2.745.915,46	332.655,11	(67.435,76)	-1,89%	(353.023,02)	(1.472,79)	564.636,25
POWE3	73.160,00	10.616,50	6.015,78	0,17%	-	-	-
QUAL3	196.765,00	29.674,13	12.346,16	0,35%	84.737,22	274,92	(75.818,62)
RAIL3	2.331.661,80	171.600,07	107.489,64	3,01%	432.027,71	1.545,74	(480.916,64)
RECV3	820.380,00	243.644,74	130.622,54	3,66%	-	-	-
RENT3	4.138.925,10	597.216,92	500.085,66	14,01%	1.169.890,86	4.018,79	(1.187.873,07)
SEER3	423.874,44	70.684,69	(10.008,04)	-0,28%	75.532,31	271,08	(84.670,97)
SOMA3	2.028.522,56	454.628,66	362.452,14	10,15%	609.606,25	2.079,12	(609.113,66)
SULA11	2.658.367,11	210.369,46	(31.904,38)	-0,89%	609.468,13	2.140,17	(650.216,90)
SUZB3	4.055.370,48	613.647,64	199.599,28	5,59%	1.521.878,27	5.041,20	(1.425.264,66)
SYNE3	283.433,00	47.273,25	(31.291,19)	-0,88%	-	-	-
TEND3	1.711.118,00	147.317,44	28.429,60	0,80%	514.723,43	1.755,31	(514.172,64)
UGPA1	5,38	1,72	(0,32)	0,00%	-	-	-
USIM5	336.550,00	55.842,65	17.936,84	0,50%	50.374,45	183,06	(58.109,66)
VBBR3	2.765.080,08	267.251,43	234.271,12	6,56%	-	-	-
WEST3	40.356,00	51.281,46	28.230,29	0,79%	-	-	-
YDUQ3	600.768,00	98.333,61	32.145,23	0,90%	95.769,37	346,54	(109.391,54)
COMPROMISSADA	1.312.577,36	27,29	15,60	0,00%	61,03	(31,74)	(94,20)
Total	68.922.567,82	8.053.231,95	3.569.591,80	100,00%	14.182.275,78	47.336,78	(13.582.990,41)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIA RVA EMB IV CNPJ - 38452613000132

Dados Gerais

PL:	70.371.905,39	VAR / PL:	7,734%
VAR:	5.442.314,35	ETL / PL:	9,6983%
ETL:	6.824.884,10	VAR / CDI:	26434,14%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(133,96)	BAIXA 1:	137,03	Cenário 1:	8.474.670,65
				Cenário 2:	21.749,29
				Cenário 3:	(2.715.620,39)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(9.564,46)	-	-	0,00%	-	-	-
UNT	3.885.184,60	379.566,73	283.249,42	5,20%	1.408.234,15	4.687,70	(1.333.199,61)
BIDI11	1.750.327,50	493.804,42	362.740,74	6,67%	2.305.666,51	5.744,18	(1.191.662,94)
BIDI3	938,96	-	-	0,00%	-	-	-
BIDI4	9.845,15	2.432,10	1.850,94	0,03%	11.107,49	29,03	(6.317,53)
BRML3	2.674.424,34	276.682,53	169.129,48	3,11%	888.502,67	2.992,54	(863.320,73)
CESP6	4.210.203,00	265.484,82	(88.578,04)	-1,63%	(118.929,08)	(470,31)	167.172,73
CLSA3	1.795.390,00	141.789,71	24.307,08	0,45%	-	-	-
ELET3	1.407.632,47	148.561,26	57.681,24	1,06%	112.617,53	422,44	(139.784,79)
ELET6	721.231,92	77.791,29	43.946,52	0,81%	76.125,68	282,20	(91.933,60)
EQTL3	7.518.322,24	708.337,12	621.562,28	11,42%	1.014.620,59	3.711,48	(1.188.208,30)
ESPA3	1.477.722,27	629.503,24	495.301,93	9,10%	-	-	-
GGPS3	2.605.791,80	466.591,36	314.872,42	5,79%	-	-	-
GMAT3	4.609.167,11	840.562,50	(297.331,35)	-5,46%	(757.078,97)	(3.223,18)	1.272.715,26
GNDI3	3.191.286,32	527.368,43	364.187,13	6,69%	1.317.262,65	4.302,15	(1.195.865,85)
HAPV3	1.162.931,96	230.581,69	162.089,64	2,98%	562.873,34	1.791,12	(482.807,98)
INTB3	1.048.825,68	180.479,20	154.758,41	2,84%	-	-	-
MATD3	1.989.816,12	102.157,94	30.775,55	0,57%	-	-	-
MULT3	1.050.991,48	88.593,25	15.745,36	0,29%	207.761,19	739,39	(228.481,05)
NTCO3	5.582.344,50	540.219,50	343.671,16	6,31%	2.277.812,34	7.452,44	(2.075.920,37)
OMGE3	2.314.305,57	204.374,94	55.082,36	1,01%	278.143,43	1.024,24	(330.764,38)
PETR4	2.864.247,50	356.586,46	(150.708,43)	-2,77%	(408.274,03)	(1.716,73)	665.691,09
PRI03	4.899.691,08	1.413.971,14	(238.527,25)	-4,38%	(2.172.659,31)	(11.180,32)	5.964.046,28
RAIL3	6.048.969,03	445.177,55	163.736,20	3,01%	1.120.798,17	4.010,07	(1.247.629,43)
UGPA1	93,48	29,86	(2,78)	0,00%	-	-	-
UGPA3	2.559.770,55	380.040,94	102.512,07	1,88%	349.840,41	1.278,73	(408.969,64)
VBBR3	658.100,64	63.606,96	44.459,47	0,82%	-	-	-
VITT3	249.795,60	3.072.782,22	2.405.744,70	44,20%	-	-	-
COMPROMISSADA	5.288.531,16	109,94	58,10	0,00%	245,89	(127,87)	(379,54)
Total	71.567.317,57	12.037.187,12	5.442.314,35	100,00%	8.474.670,65	21.749,29	(2.715.620,39)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIA RVA EMB IV CNPJ - 38452613000132

Dados Gerais

PL:	57.379.547,31	VAR / PL:	8,832%
VAR:	5.067.499,53	ETL / PL:	11,0751%
ETL:	6.354.851,03	VAR / CDI:	37285,08%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	70,81	BAIXA 1:	71,23	Cenário 1:	3.156.350,13
				Cenário 2:	9.791,14
				Cenário 3:	-2.328.165,10

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%	-	-	-
RECEBER	- 792.869,88	-	-	0,00%	-	-	-
UNT	3.041.642,72	289.715,31	47.600,16	-0,94%	620.302,35	2.201,66	678.031,63
BIDI11	1.534.365,15	428.839,22	24.072,77	-0,48%	586.182,34	1.936,73	545.863,88
BIDI3	938,96	162,40	53,36	0,00%	-	-	-
BIDI4	12.622,40	3.348,94	147,88	0,00%	4.875,81	16,08	4.524,36
BRDT3	847.354,77	96.653,06	16.887,84	-0,33%	146.947,38	528,47	165.509,97
BRML3	1.980.504,96	129.760,02	33.265,28	-0,66%	531.240,55	1.835,63	546.541,87
CESP6	2.673.124,20	158.334,41	137.071,90	2,70%	153.203,09	615,01	223.223,51
CLSA3	1.267.590,00	123.962,12	97.151,99	-1,92%	-	-	-
ELET3	1.385.320,23	121.357,26	66.826,62	1,32%	98.782,98	372,06	123.782,71
ELET6	573.559,36	48.077,43	28.388,72	0,56%	28.439,31	108,22	36.505,09
EQTL3	8.329.959,30	514.650,68	372.850,02	7,36%	572.320,87	2.311,32	845.989,70
ESPA3	1.567.219,49	224.110,10	78.754,26	1,55%	-	-	-
GGPS3	2.184.224,90	389.521,46	192.277,43	-3,79%	-	-	-
GMAT3	3.388.210,14	244.540,90	105.364,41	-2,08%	480.148,01	1.751,08	558.401,35
GNDI3	2.359.914,30	166.793,64	36.381,14	0,72%	58.431,59	225,04	77.146,40
HAPV3	842.770,26	66.581,83	11.945,14	0,24%	13.768,46	53,25	18.355,90
INTB3	681.438,54	89.553,05	45.078,09	0,89%	-	-	-
LCAM3	812.767,69	79.577,68	40.811,94	0,81%	26.276,22	100,83	34.392,80
MATD3	1.371.954,12	92.048,40	36.421,25	-0,72%	-	-	-
MULT3	702.359,24	50.908,07	7.710,84	-0,15%	172.276,65	600,93	181.044,84
NTCO3	4.493.429,85	592.242,97	213.519,39	-4,21%	1.069.619,42	3.742,25	-1.131.717,45
OMGE3	1.330.357,60	135.648,10	114.015,31	2,25%	34.606,79	136,70	48.513,22
PETRA	2.510.224,78	225.052,38	131.990,26	-2,60%	201.016,11	754,01	249.488,11
PRI03	5.224.201,02	1.097.931,94	743.294,37	14,67%	-1.138.667,87	5.004,91	2.072.239,85
RAIL3	4.397.250,63	372.167,68	19.622,45	0,39%	664.642,44	2.413,78	765.555,73
UGPA3	2.172.734,96	308.288,11	114.975,84	2,27%	352.096,38	1.272,57	401.110,25
VITT3	249.795,60	4.611.751,54	4.163.837,75	82,17%	-	-	-
COMPROMISSADA	2.713.960,24	55,77	2,16	0,00%	102,75	53,52	159,04
Total	57.857.925,53	10.661.634,47	5.067.499,53	100,00%	3.156.350,13	9.791,14	-2.328.165,10



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIA RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	17.281.530,45	VAR / PL:	3,750%
VAR:	648.043,92	ETL / PL:	4,7026%
ETL:	812.673,50	VAR / CDI:	12817,50%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(26,53)	BAIXA 1:	27,14	Cenário 1:	2.562.073,24
				Cenário 2:	7.707,23
				Cenário 3:	(1.905.093,72)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	5.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	152.005,10	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	606.543,00	55.063,49	(1.291,90)	-0,20%	79.823,44	292,43	(93.804,10)
ALPA4	50.219,00	14.290,26	3.739,18	0,58%	30.945,41	94,08	(24.064,83)
AMER3	131.808,60	32.120,70	4.572,42	0,71%	-	-	-
ASAI3	99.385,00	21.620,72	3.729,09	0,58%	-	-	-
AZUL4	67.149,00	16.702,23	9.319,78	1,44%	29.242,81	94,71	(26.063,21)
B3SA3	593.118,00	43.870,91	12.450,17	1,92%	147.407,84	513,49	(154.441,42)
UNT	241.285,00	23.572,56	15.219,09	2,35%	87.456,79	291,12	(82.796,86)
BBAS3	333.450,00	30.648,68	15.562,11	2,40%	(2.654,07)	(10,39)	3.640,77
BBDC3	191.930,00	19.144,62	8.626,57	1,33%	22.343,38	82,42	(26.675,60)
BBDC4	763.961,00	88.023,85	30.483,70	4,70%	65.532,67	245,16	(80.833,80)
BBSE3	123.704,00	21.753,10	(1.937,09)	-0,30%	(20.201,82)	(85,96)	33.915,17
BEEF3	19.480,00	4.809,30	660,07	0,10%	(3.838,82)	(16,66)	6.769,34
BIDI11	138.450,00	39.059,67	17.158,59	2,65%	182.377,03	454,36	(94.259,92)
BID4	18.345,00	4.531,86	2.219,75	0,34%	20.697,18	54,10	(11.771,80)
BPAN4	37.212,00	4.134,92	3.639,00	0,56%	16.310,17	52,77	(14.503,95)
BRAP4	100.774,86	10.039,20	3.784,69	0,58%	11.037,59	40,84	(13.273,61)
BRFS3	155.641,00	27.529,22	10.988,76	1,70%	(621,17)	(2,43)	848,10
BRKM5	119.812,00	22.189,54	6,79	0,00%	28.507,34	99,74	(30.165,40)
BRML3	49.473,00	5.118,23	3.788,64	0,58%	16.436,02	55,36	(15.970,19)
CASH3	14.895,00	8.141,89	1.890,03	0,29%	17.145,71	-	(9.634,99)
CCRO3	105.156,00	10.840,14	6.419,95	0,99%	5.285,59	20,11	(6.779,49)
CIEL3	20.586,00	3.620,32	1.136,63	0,18%	4.086,02	14,54	(4.490,00)
CMIG4	118.354,32	15.566,90	8.131,04	1,25%	3.156,20	12,14	(4.157,97)
COGN3	37.448,00	4.810,04	2.369,08	0,37%	10.068,27	34,78	(10.352,33)
CPFE3	42.096,00	4.858,78	79,84	0,01%	5.516,33	20,21	(6.486,26)
CPLB6	75.776,00	10.229,31	5.176,59	0,80%	5.524,65	20,79	(6.910,68)
CRFB3	56.576,00	2.887,12	921,32	0,14%	5.051,89	18,87	(6.207,86)
CSAN3	189.984,00	24.832,95	9.093,57	1,40%	17.484,37	65,22	(21.421,99)
CSNA3	120.734,00	14.507,34	5.727,27	0,88%	66.666,59	207,12	(54.304,71)
CVCB3	30.343,00	8.012,91	2.763,42	0,43%	11.620,97	38,38	(10.813,06)
CYRE3	32.407,00	5.774,13	2.343,54	0,36%	14.984,16	48,05	(13.072,14)
DXCO3	35.673,00	3.600,52	2.319,57	0,36%	-	-	-
ECOR3	22.932,00	2.562,55	1.673,30	0,26%	6.568,83	22,53	(6.646,96)
EGIE3	81.711,00	4.191,26	(832,56)	-0,13%	2.150,72	8,28	(2.834,48)
ELET3	101.490,00	10.711,24	5.776,66	0,89%	8.119,70	30,46	(10.078,45)
ELET6	67.680,00	7.299,89	4.120,52	0,64%	7.143,59	26,48	(8.627,00)
ENBR3	39.200,00	2.494,17	161,07	0,02%	(1.762,56)	(7,03)	2.528,88
ENEV3	149.760,00	18.167,74	3.348,15	0,52%	31.367,48	111,07	(34.104,47)
ENGI11	83.202,00	6.807,77	4.628,48	0,71%	6.026,03	22,68	(7.541,82)
EQTL3	189.904,00	17.891,76	5.009,03	0,77%	25.628,13	93,75	(30.012,75)
EZTC3	14.600,00	2.352,47	1.159,55	0,18%	7.513,51	23,65	(6.295,06)
FLRY3	47.075,00	6.538,15	1.141,34	0,18%	17.881,46	59,13	(16.682,06)
GGBR4	242.100,00	31.429,62	7.760,30	1,20%	(11.708,63)	(46,78)	16.870,30
GNDI3	308.064,00	50.908,38	2.554,60	0,39%	127.159,13	415,30	(115.440,35)
GOAU4	71.307,00	9.067,77	1.242,97	0,19%	(5.143,67)	(20,81)	7.636,53
GOLL4	20.887,68	5.063,73	2.471,57	0,38%	5.235,21	18,22	(5.474,26)
HAPV3	123.478,00	24.482,74	1.545,43	0,24%	59.764,87	190,18	(51.263,67)
HYPE3	95.404,00	12.025,58	2.377,80	0,37%	33.169,87	111,05	(31.801,80)
IGTA3	20.958,00	2.167,57	1.012,91	0,16%	3.321,52	12,02	(3.797,52)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIA RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	17.281.530,45	VAR / PL:	3,750%
VAR:	648.043,92	ETL / PL:	4,7026%
ETL:	812.673,50	VAR / CDI:	12817,50%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(26,53)	BAIXA 1:	27,14	Cenário 1:	2.562.073,24
				Cenário 2:	7.707,23
				Cenário 3:	(1.905.093,72)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
IRBR3	48.307,00	3.900,82	931,29	0,14%	5.046,32	18,72	(6.101,25)
ITSA4	380.275,00	22.377,65	18.083,86	2,79%	27.517,80	103,59	(34.442,05)
ITUB4	911.421,00	145.762,82	48.507,39	7,49%	425.527,84	1.362,44	(369.914,07)
JBSS3	433.455,00	41.051,48	12.971,20	2,00%	(108.083,02)	(484,42)	206.594,74
JHSF3	12.974,00	1.206,66	835,14	0,13%	3.638,58	12,51	(3.701,90)
KLBN11	153.698,00	14.128,10	(1.115,92)	-0,17%	20.624,75	75,47	(24.172,38)
LAME4	33.810,00	21.249,62	(2.397,41)	-0,37%	9.950,22	34,02	(9.997,68)
LCAM3	53.271,00	8.315,44	3.946,25	0,61%	16.323,95	55,54	(16.225,07)
LREN3	235.279,00	14.360,74	8.982,27	1,39%	53.334,24	187,49	(57.039,53)
LWSA3	64.050,00	6.637,99	3.863,55	0,60%	18.637,77	63,81	(18.782,44)
MGLU3	249.711,00	42.128,79	20.123,83	3,11%	210.346,42	595,59	(140.862,93)
MRFG3	76.850,00	11.590,12	2.974,94	0,46%	(25.561,19)	(121,06)	56.285,98
MRVE3	24.360,00	3.978,20	942,59	0,15%	11.488,31	36,72	(9.949,94)
MULT3	42.596,00	3.590,63	1.774,34	0,27%	8.420,43	29,97	(9.260,19)
NTCO3	272.300,00	26.351,25	7.025,98	1,08%	111.108,93	363,52	(101.260,88)
PACUCAR_CBD ON ED	33.189,00	5.735,62	1.253,78	0,19%	4.570,69	16,70	(5.337,46)
PETR3	777.527,00	94.193,84	38.585,31	5,95%	(99.961,17)	(417,03)	159.881,08
PETRA4	1.016.425,00	126.540,53	44.236,41	6,83%	(144.882,71)	(609,21)	236.231,35
PETZ3	39.417,00	10.795,76	3.571,04	0,55%	23.141,42	71,05	(18.375,08)
PRI03	164.290,00	47.411,42	8.431,86	1,30%	(72.850,76)	(374,88)	199.978,56
QUAL3	39.353,00	5.934,83	(462,88)	-0,07%	16.947,44	54,98	(15.163,72)
RADL3	204.600,00	28.737,11	(1.787,38)	-0,28%	63.362,43	215,32	(62.796,88)
RAIL3	159.900,00	11.767,94	8.215,14	1,27%	29.627,47	106,00	(32.980,16)
RDOR3	153.400,00	18.326,77	5.892,29	0,91%	26.675,22	-	-
RENT3	221.970,00	32.028,66	14.538,83	2,24%	62.741,09	215,53	(63.705,47)
SBSP3	98.560,00	10.600,46	6.271,98	0,97%	(1.798,29)	(7,08)	2.497,38
SOMA3	45.093,44	10.106,26	5.316,13	0,82%	13.551,36	46,22	(13.540,41)
SULA11	59.731,00	4.726,80	(808,47)	-0,12%	13.694,17	48,09	(14.609,76)
SUZB3	295.380,00	44.696,10	5.685,79	0,88%	110.848,66	367,18	(103.811,64)
TAEE11	65.988,00	3.758,62	1.345,63	0,21%	3.606,01	13,69	(4.602,60)
TIMS3	74.052,00	4.755,91	3.450,73	0,53%	5.675,71	21,32	(7.070,70)
TOTS3	137.592,00	20.157,70	4.937,86	0,76%	44.178,58	149,45	(43.346,42)
UGPA1	11,61	3,71	(0,47)	0,00%	-	-	-
UGPA3	116.145,00	17.243,68	8.864,27	1,37%	15.873,38	58,02	(18.556,26)
USIM5	56.975,00	9.453,68	6.730,03	1,04%	8.527,96	30,99	(9.837,46)
VALE3	1.969.275,00	204.089,46	77.379,67	11,94%	463.950,94	1.624,87	(492.017,93)
VBBR3	201.408,00	19.466,55	12.698,55	1,96%	-	-	-
VIIA3	80.565,00	15.273,51	9.568,70	1,48%	-	-	-
VIVT3	168.424,00	14.648,16	4.337,58	0,67%	(14.202,71)	(57,84)	21.419,17
WEGE3	451.400,00	47.763,91	11.186,05	1,73%	(7.714,75)	(30,34)	10.699,01
YDUQ3	52.150,00	8.535,90	4.902,51	0,76%	8.313,31	30,08	(9.495,79)
COMPROMISSADA	1.047.519,36	21,78	11,29	0,00%	48,70	(25,33)	(75,18)
Total	17.281.223,97	1.999.472,78	648.043,92	100,00%	2.562.073,24	7.707,23	(1.905.093,72)



Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	86.953.947,29	VAR / PL:	3,940%
VAR:	3.426.163,66	ETL / PL:	4,9412%
ETL:	4.296.548,93	VAR / CDI:	13467,90%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(732,44)	BAIXA 1:	930,41	Cenário 1:	13.620.997,12
				Cenário 2:	41.128,96
				Cenário 3:	(10.169.648,16)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	45.464,99	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	3.209.665,85	291.381,51	(3.874,30)	-0,11%	422.404,65	1.547,48	(496.386,59)
ALPA4	281.728,59	80.168,38	21.098,18	0,62%	173.603,75	527,80	(135.003,70)
AMER3	703.385,10	171.409,32	24.703,29	0,72%	-	-	-
ASAI3	526.480,57	114.533,25	18.749,45	0,55%	-	-	-
AZUL4	353.004,78	87.804,26	47.905,89	1,40%	153.730,51	497,87	(137.015,26)
B3SA3	3.137.177,37	232.046,30	64.814,94	1,89%	779.683,89	2.716,01	(816.886,55)
UNT	1.272.744,55	124.341,96	79.927,58	2,33%	461.322,31	1.535,64	(436.741,81)
BBAS3	1.755.115,50	161.319,44	80.742,95	2,36%	(13.969,69)	(54,68)	19.163,21
BBDC3	1.016.515,00	101.395,29	46.567,37	1,36%	118.336,80	436,51	(141.281,44)
BBDC4	4.045.311,80	466.102,22	165.425,37	4,83%	347.007,35	1.298,16	(428.029,62)
BBSE3	642.001,67	112.894,71	(10.460,97)	-0,31%	(104.843,82)	(446,12)	176.013,67
BEEF3	102.942,06	25.414,77	3.079,85	0,09%	(20.286,24)	(88,05)	35.772,58
BIDI11	736.305,50	207.727,36	92.039,75	2,69%	969.918,45	2.416,39	(501.293,60)
BIDI4	98.414,81	24.311,89	11.950,57	0,35%	111.033,46	290,22	(63.151,80)
BPAN4	196.293,30	21.811,69	19.049,89	0,56%	86.036,16	278,35	(76.508,34)
BRAP4	528.982,86	52.697,31	20.113,36	0,59%	57.938,04	214,39	(69.675,23)
BRFS3	816.836,49	144.479,09	55.473,01	1,62%	(3.260,04)	(12,74)	4.451,02
BRKM5	623.131,32	115.405,79	1.585,40	0,05%	148.264,09	518,75	(156.887,50)
BRML3	262.443,51	27.151,09	19.769,82	0,58%	87.189,51	293,66	(84.718,39)
CASH3	78.086,21	42.683,41	9.675,00	0,28%	89.885,44	-	(50.510,88)
CCRO3	552.137,58	56.917,80	33.113,12	0,97%	27.752,80	105,58	(35.596,73)
CIEL3	108.685,32	19.113,77	6.000,04	0,18%	21.572,44	76,75	(23.705,27)
CMIG4	621.498,64	81.744,42	41.746,71	1,22%	16.573,76	63,77	(21.834,23)
COGN3	198.481,84	25.494,18	12.298,25	0,36%	53.363,83	184,34	(54.869,42)
CPFE3	213.058,38	24.591,50	368,98	0,01%	27.919,52	102,31	(32.828,57)
CPLE6	401.245,76	54.165,78	27.016,55	0,79%	29.253,86	110,10	(36.593,12)
CRFB3	295.592,96	15.084,36	4.532,38	0,13%	26.394,63	98,58	(32.434,27)
CSAN3	1.003.689,43	131.193,00	46.218,62	1,35%	92.370,30	344,56	(113.172,82)
CSNA3	633.397,90	76.108,78	31.081,30	0,91%	349.748,02	1.086,62	(284.894,83)
CVCB3	155.116,61	40.962,85	13.558,48	0,40%	59.407,64	196,21	(55.277,48)
CYRE3	172.560,23	30.746,00	12.115,97	0,35%	79.787,37	255,88	(69.606,30)
DXCO3	183.126,57	18.483,17	12.037,31	0,35%	-	-	-
ECOR3	120.417,57	13.456,11	8.591,82	0,25%	34.493,42	118,31	(34.903,68)
EGIE3	432.134,46	22.165,75	(4.336,34)	-0,13%	11.374,25	43,77	(14.990,37)
ELET3	523.485,42	55.248,55	28.937,55	0,84%	41.881,41	157,10	(51.984,66)
ELET6	357.688,80	38.579,92	21.117,48	0,62%	37.753,88	139,96	(45.593,68)
ENBR3	197.156,40	12.544,42	841,73	0,02%	(8.864,79)	(35,36)	12.719,01
ENEV3	787.838,40	95.574,53	16.711,03	0,49%	165.014,05	584,32	(179.412,48)
ENGI11	426.628,16	34.907,64	23.354,49	0,68%	30.899,18	116,32	(38.671,59)
EQTL3	1.001.068,64	94.315,47	25.895,65	0,76%	135.097,28	494,19	(158.210,57)
EZTC3	80.774,50	13.015,05	6.288,17	0,18%	41.568,51	130,85	(34.827,39)
FLRY3	246.861,30	34.286,06	5.853,97	0,17%	93.770,38	310,07	(87.480,71)
GETT11	17.156,60	129.374,86	(41.859,90)	-1,22%	-	-	-
GGBR4	1.279.310,20	166.081,08	42.325,62	1,24%	(61.871,01)	(247,22)	89.146,41
GNDI3	1.644.612,50	271.776,52	13.122,11	0,38%	678.844,33	2.217,09	(616.283,13)
GOAU4	377.964,63	48.063,96	6.895,78	0,20%	(27.264,17)	(110,31)	40.477,61
GOLL4	110.237,16	26.724,45	12.645,03	0,37%	27.629,43	96,16	(28.891,05)
HAPV3	653.498,66	129.573,21	7.906,96	0,23%	316.301,37	1.006,50	(271.309,40)
HYPE3	502.077,58	63.286,37	12.576,77	0,37%	174.561,31	584,40	(167.361,65)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	86.953.947,29	VAR / PL:	3,940%
VAR:	3.426.163,66	ETL / PL:	4,9412%
ETL:	4.296.548,93	VAR / CDI:	13467,90%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(732,44)	BAIXA 1:	930,41	Cenário 1:	13.620.997,12
				Cenário 2:	41.128,96
				Cenário 3:	(10.169.648,16)

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
IGTA3	112.544,46	11.639,85	5.280,86	0,15%	17.836,56	64,57	(20.392,68)
IRBR3	255.075,03	20.597,48	5.144,41	0,15%	26.646,06	98,83	(32.216,36)
ITSA4	2.006.007,00	118.045,44	95.407,08	2,78%	145.160,48	546,47	(181.686,94)
ITUB4	4.828.480,02	772.214,91	260.142,43	7,59%	2.254.339,83	7.217,85	(1.959.712,04)
JBSS3	2.278.645,60	215.805,07	65.979,49	1,93%	(568.185,63)	(2.546,58)	1.086.055,51
JHSF3	65.942,85	6.133,07	4.187,44	0,12%	18.493,79	63,59	(18.815,62)
KLBN11	808.107,38	74.282,19	(4.776,04)	-0,14%	108.440,01	396,81	(127.092,62)
LAME4	178.482,99	112.176,74	(13.164,26)	-0,38%	52.527,24	179,60	(52.777,73)
LCAM3	277.758,94	43.357,34	19.895,95	0,58%	85.114,29	289,61	(84.598,72)
LREN3	1.242.273,12	75.824,70	46.571,39	1,36%	281.604,77	989,93	(301.168,72)
LWSA3	342.319,80	35.477,23	20.694,03	0,60%	99.610,92	341,03	(100.384,07)
MGLU3	1.321.187,39	222.897,78	106.287,04	3,10%	1.112.914,66	3.151,17	(745.286,85)
MRFG3	400.812,50	60.448,45	14.636,86	0,43%	(133.314,85)	(631,40)	293.560,50
MRVE3	130.041,80	21.236,94	4.759,16	0,14%	61.328,41	196,02	(53.116,10)
MULT3	219.610,16	18.512,02	8.938,99	0,26%	43.412,78	154,50	(47.742,31)
NTCO3	1.424.051,20	137.809,52	35.858,79	1,05%	581.067,94	1.901,11	(529.565,47)
PACUCAR_CBD ON ED	173.578,47	29.997,28	6.431,39	0,19%	23.904,72	87,34	(27.914,90)
PETR3	4.107.556,16	497.611,66	205.173,61	5,99%	(528.079,58)	(2.203,11)	844.627,28
PETR4	5.393.456,25	671.462,05	236.049,21	6,89%	(768.791,14)	(3.232,65)	1.253.514,49
PETZ3	210.580,63	57.675,04	18.979,67	0,55%	123.630,29	379,56	(98.166,66)
PRIQ3	852.899,80	246.133,01	42.436,93	1,24%	(378.199,49)	(1.946,18)	1.038.174,41
QUAL3	210.795,20	31.790,03	(2.700,51)	-0,08%	90.779,36	294,52	(81.224,81)
RADL3	1.079.125,50	151.568,67	(9.271,80)	-0,27%	334.193,62	1.135,64	(331.210,73)
RAIL3	842.465,13	62.001,73	42.899,45	1,25%	156.098,23	558,50	(173.762,55)
RDOR3	821.516,00	98.146,89	31.585,29	0,92%	142.856,05	-	-
RENT3	1.163.802,30	167.928,24	73.473,48	2,14%	328.955,38	1.130,02	(334.011,70)
SANB11	541.456,00	50.211,06	24.161,37	0,71%	74.947,51	273,73	(87.457,38)
SBSP3	518.531,20	55.769,77	32.134,22	0,94%	(9.460,94)	(37,22)	13.138,89
SOMA3	109.315,84	24.499,66	12.701,86	0,37%	32.851,31	112,04	(32.824,76)
SULA11	321.015,17	25.403,48	(4.265,08)	-0,12%	73.597,25	258,44	(78.517,93)
SUZB3	1.552.271,13	234.885,45	32.200,57	0,94%	582.528,21	1.929,62	(545.547,49)
TAE11	347.720,10	19.805,83	7.354,78	0,21%	19.001,65	72,14	(24.253,17)
TIMS3	393.261,00	25.256,74	18.229,38	0,53%	30.141,44	113,24	(37.549,73)
TOTS3	739.098,36	108.280,42	26.597,66	0,78%	237.312,59	802,79	(232.842,52)
UGPA1	24,00	7,67	(0,99)	0,00%	-	-	-
UGPA3	613.193,40	91.038,86	45.450,24	1,33%	83.804,32	306,32	(97.968,74)
USIM5	294.971,50	48.943,66	34.720,79	1,01%	44.151,02	160,45	(50.930,60)
VALE3	10.490.936,61	1.087.247,61	422.671,54	12,34%	2.471.610,04	8.656,18	(2.621.131,60)
VBBR3	1.058.461,98	102.302,82	66.170,43	1,93%	-	-	-
VIIA3	425.204,85	80.610,32	50.967,82	1,49%	-	-	-
VIVT3	875.759,28	76.166,49	22.381,94	0,65%	(73.850,26)	(300,73)	111.373,88
WEGE3	2.381.986,00	252.044,65	56.300,68	1,64%	(40.709,86)	(160,08)	56.457,46
YDUQ3	271.868,38	44.499,37	25.093,67	0,73%	43.338,97	156,82	(49.503,47)
INDZ21	939.213,00	38.373,53	37.079,59	1,08%	-	-	-
COMPROMISSADA	1.250.425,58	25,99	13,51	0,00%	58,14	(30,23)	(89,74)
EMP AÇÃO PROVISÃO	4.568,12	1,68	0,86	0,00%	3,41	(1,77)	(5,25)
LFT	299.195,44	37,35	6,45	0,00%	0,01	-	(0,01)
Total	87.914.126,65	10.754.844,37	3.426.163,66	100,00%	13.620.997,12	41.128,96	(10.169.648,16)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 29/10/2021

FIM EMB V A INVEST NO EXT CNPJ - 41252756000105

Dados Gerais

PL:	81.931.603,10	VAR / PL:	19,594%
VAR:	16.053.376,48	ETL / PL:	24,5712%
ETL:	20.131.588,65	VAR / CDI:	66972,40%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	7.634.308,47	BAIXA 1:	(8.435.049,25)	Cenário 1:	(7.653.434,20)
				Cenário 2:	(606.206,08)
				Cenário 3:	11.996.361,01

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	145.569,35	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(27.816,73)	-	-	0,00%	-	-	-
EWJ_US	4.449.142,09	190.821,75	(968,20)	-0,01%	(505.539,22)	(40.042,28)	792.406,50
SPY	9.023.877,89	387.030,16	(1.963,73)	-0,01%	(1.025.349,18)	(81.214,90)	1.607.181,64
VTV_US	6.996.273,51	300.067,10	(1.522,49)	-0,01%	(794.960,15)	(62.966,46)	1.246.058,78
LFT	10.965,87	6,85	0,59	0,00%	0,00	-	(0,00)
AB AMERICAN GROWTH	9.602.033,08	535.776,81	(154.262,20)	-0,96%	(1.091.042,77)	(86.418,30)	1.710.152,93
FUNDSMITH EQ FUND	10.984.827,88	572.132,31	(120.701,76)	-0,75%	(1.248.164,52)	(98.863,45)	1.956.433,13
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.472.638,81	118.562,77	21.299,83	0,13%	-	-	-
JANUS H GL FICFIA IE	3.820.655,62	87.770,39	16.118,51	0,10%	-	-	-
LOOMIS US GROWTH	8.092.675,37	13.845.458,84	13.704.723,06	85,37%	(919.540,15)	(72.834,08)	1.441.331,47
EUROPEA	7.297.365,61	465.346,07	(108.566,98)	-0,68%	(829.172,10)	(65.676,29)	1.299.684,25
PICTET GL FIC FIM IE	3.780.388,53	82.285,96	15.346,73	0,10%	-	-	-
QUAL	10.910.035,21	2.692.152,32	2.683.873,12	16,72%	(1.239.666,11)	(98.190,32)	1.943.112,31
Total	79.558.632,08	19.277.411,34	16.053.376,48	100,00%	(7.653.434,20)	(606.206,08)	11.996.361,01



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

29/10/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB II	20/10/14	15/01/13	15/01/23	SABESP	1.135.536,19	BRSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	21/10/14	15/01/13	15/01/23	SABESP	5.673.341,94	BRSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	24/02/15	15/01/13	15/01/23	SABESP	2.922.329,91	BRSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	04/03/15	04/03/15	02/03/22	B VOTORA	24.208.461,53	BRZXSZLFN364	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/05/15	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	1.098.502,28	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	1.097.714,78	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	1.207.693,94	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/06/15	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	1.416.247,46	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	09/06/15	09/06/15	07/06/22	B VOTORA	11.232.755,04	BRZXSZLFN6P8	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB II	30/06/15	30/06/15	28/06/22	B VOTORA	11.295.702,79	BRZXSZLFN7G5	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	12/08/15	16/07/13	16/07/23	DUKE GEP	2.661.233,05	BRGEPADBS079	-	Aaa.br	-
FI RF EMB II	06/11/15	06/11/15	04/11/22	BRADESCO	6.836.462,82	BRBDCLFR744	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	18/11/15	18/11/15	16/11/22	BRADESCO	17.012.717,25	BRBDCLFR8X2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/01/11	15/04/22	ECPT	16.546,86	BRASCPDBS011	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/01/11	15/07/22	ECPT	16.120,81	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/01/11	15/10/22	ECPT	15.697,84	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/01/11	15/01/23	ECPT	49.497,10	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	11/02/16	15/01/11	15/01/23	ECPT	172.242,67	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/01/11	15/07/22	ECPT	140.861,05	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/01/11	15/10/22	ECPT	137.337,22	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/01/11	15/04/22	ECPT	66.342,90	BRASCPDBS011	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/01/11	15/04/22	ECPT	78.000,23	BRASCPDBS011	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/01/11	15/01/23	ECPT	828.450,63	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.610.734,40	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	594.098,66	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	356.459,19	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.186.230,70	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/11	15/01/23	ECPT	434.186,30	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/11	15/01/23	ECPT	279.264,58	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/09/16	15/01/11	15/10/22	ECPT	369.738,73	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	10/10/16	15/01/13	15/01/23	SABESP	224.767,38	BRSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FIM EMB II A	12/12/16	12/12/16	12/01/22	LOCALIZA	541.549,84	BRRENTDBS0C4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	12/12/16	12/12/16	12/01/22	LOCALIZA	613.075,29	BRRENTDBS0C4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	08/02/17	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.123.481,40	BRVIVTDBS069	brAAA	-	-
FIM EMB II A	08/02/17	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.518.218,11	BRVIVTDBS069	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/01/11	15/04/22	ECPT	280.326,15	BRASCPDBS011	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/01/11	15/07/22	ECPT	275.497,75	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/01/11	15/10/22	ECPT	270.688,68	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/01/11	15/01/23	ECPT	403.417,62	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/01/11	15/01/23	ECPT	759.748,85	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/01/11	15/07/22	ECPT	17.638,28	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/17	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	2.610.414,15	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	16.212.717,57	BRPETRDBS084	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FIM EMB II A	22/09/17	22/09/17	15/09/22	ENERSUL	268.041,75	BRENERDBS024	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	4.048.077,87	BRBRACRI4G2	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	1.181.426,16	BRBRACRI4G2	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	4.219.158,85	BRBRACRI4G2	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	29/01/18	27/10/17	27/10/22	SUL AME	647.067,65	BRSLULADBS040	-	-	A+(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	8.658.287,24	BRSPDBS1A7	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.373.413,07	BRSPDBS1A7	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	11.872.826,96	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	25.713.396,27	BRGASADBS093	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	583.980,17	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	583.980,17	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	583.980,17	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	583.980,17	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	11.007.719,98	BRERDVDBS0E8	-	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	12.685.681,92	BRAGPDBS038	brA	Aa1.br	-
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	14.219.969,96	BRCSMGDBS0E7	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/12	15/02/22	CEMIG G	1.554.674,43	BRMGTDDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/12	15/02/22	CEMIG G	75.206,30	BRMGTDDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/12	15/02/22	CEMIG G	527.676,97	BRMGTDDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	815.581,29	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	462.897,49	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	1.223.371,94	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	2.379.195,80	BRMGDDDBS041	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB II A	14/11/18	14/11/18	15/03/24	BRADESCO	303.562,16	BRBDCLTR6K7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	04/01/19	04/01/19	07/06/24	MOV_PART	1.180.739,25	BRMOVDBS085	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB II A	17/01/19	17/01/19	16/09/24	ITALUUB	292.113,26	BRBITALFIU67	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITALUUB	2.524.230,43	BRBITALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITALUUB	2.524.230,43	BRBITALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	19/08/20	19/08/20	14/08/24	B3SA	1.685.740,39	BRB3SADBS032	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	512.419,77	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.244.504,04	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	1.847.667,44	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	5.586.114,59	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	631.402,77	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.108.622,49	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/10/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	7.576.833,36	BRGRRRBDS042	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	780.643,44	BRGRRRBDS042	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	560.459,12	BROMGEDBS028	-	-	AA+(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	BCBF	258.412,96	BRBCBFDBS032	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.323.319,51	BRE RDVDS0F5	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	20/01/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	578.896,17	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	20/01/21	31/07/18	23/07/23	COPEL GT	178.904,94	BRCPGTDBS032	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	04/02/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	195.683,21	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	05/02/21	31/07/18	23/07/23	COPEL GT	112.438,18	BRCPGTDBS032	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	269.064,42	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	286.461,57	BRCPGTDBS057	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	21/08/12	22/08/22	ITA U	4.922.760,31	BRBITALFIBU7	brAAA	Aa1.br	AAA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	5.806.914,00	BRENTVDS008	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	5.821.696,83	BRENTVDS008	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.762.323,22	BRELETDBS032	brAAA	Ba2	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	524.912,52	BRNEOEDBS047	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	5.217.892,43	BRNEOEDBS047	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.557.961,75	BRELETDBS032	brAAA	Ba2	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	2.986.052,23	BRELETDBS032	brAAA	Ba2	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.194.777,70	BRELETDBS032	brAAA	Ba2	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.434.662,39	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.395.538,69	BRCGASDBS093	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	05/11/12	07/11/22	ITA U	9.240.875,44	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	05/11/12	07/11/22	ITA U	776.200,43	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	05/11/12	07/11/22	ITA U	776.200,43	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	05/11/12	07/11/22	ITA U	6.209.603,43	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	05/11/12	07/11/22	ITA U	3.881.002,14	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	05/11/12	07/11/22	ITA U	5.433.403,00	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/12	15/02/22	CEMIG G	617.421,35	BRRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/12	15/02/22	CEMIG G	154.355,34	BRRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/12	15/02/22	CEMIG G	1.102.097,10	BRRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	16/07/13	16/07/23	DUKE GEP	10.779.975,64	BRGEPADBS079	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	611.719,79	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/12	15/02/22	CEMIG G	156.825,02	BRRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.076.626,82	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/12	15/02/22	CEMIG G	1.123.706,85	BRRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.223.439,57	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	611.719,79	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/01/11	15/10/22	ECP T	165.519,10	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/01/11	15/07/22	ECP T	132.282,53	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	748.745,02	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/11/12	14/11/22	ITA U	7.764.535,19	BRBITALFIDR9	brAAA	Aa1.br	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/22	ECORODOV	1.670.466,12	BRE RDVDS052	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/22	ECORODOV	557.367,47	BRE RDVDS052	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	03/06/14	15/05/22	SUL AME	1.573.725,75	BRSLULADBS053	-	-	A+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/22	ECORODOV	696.973,05	BRE RDVDS052	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	626.865,30	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.818.758,14	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	11.027.491,72	BRBBDCLFRZJ5	brAAA	Aa1.br	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	5.644.279,02	BRCCRODDBS0G5	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	3.871.271,56	BRE RDVDS0D0	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	1.261.957,04	BRSPSPDBS1A7	brAAA	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	9.953.572,75	BRGASDBS093	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.822.503,37	BRENJGDBS018	-	-	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.098.090,51	BRENMDBS018	-	-	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	3.595.793,73	BRBBDCLTR2J8	brAAA	Aa1.br	AAA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	27/07/17	15/07/24	SONAE	373.587,55	BRSSBRDBS037	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	27/07/17	15/07/24	SONAE	435.852,15	BRSSBRDBS037	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	27/07/17	15/07/24	SONAE	435.852,15	BRSSBRDBS037	-	-	AA+(bra)
FIM EMB I A	28/05/21	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	984.587,35	BRBRMLFI52	-	Aa1.br	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	575.375,15	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	141.825,94	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	435.855,32	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VARONDO	3.220.918,15	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VARONDO	638.703,01	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VARONDO	586.004,74	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	1.343.310,72	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	1.595.830,08	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	3.342.710,54	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	656.089,10	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	601.895,45	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VARONDO	1.306.917,05	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	02/10/20	15/09/34	BRKA	4.320.681,48	BRBRKPDDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAME	3.606.511,33	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	20/11/20	15/10/38	TAUBATE	8.439.843,20	BRLTTEDBS048	-	-	AAA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	5.741.495,57	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAME	925.042,98	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	3.518.172,42	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	06/04/21	15/03/29	ANET	2.805.302,41	BRANETDBS002	brA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.364.491,24	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/10/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	3.154.223,44	BRBRSTDBS001	brA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	961.503,39	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/04/19	15/03/27	GETI	1.567.739,46	BRTIETHDBS01	-	Aa1.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	28/06/13	15/05/23	LIGHT	842.601,74	BRLIGHDBS007	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	28/06/13	15/05/23	LIGHT	1.885.822,94	BRLIGHDBS007	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	28/06/13	15/05/23	LIGHT	1.187.667,21	BRLIGHDBS007	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	28/06/13	15/05/23	LIGHT	866.676,07	BRLIGHDBS007	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAME	433.613,90	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	3.298.286,64	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	7.821.027,76	BRRENTDBS007	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.930.968,59	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.553.544,95	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	4.334.212,25	BRQUATDBS019	-	-	A-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.136.308,01	BRNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	26/08/20	25/08/25	COSAN LO	30.539,70	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	432.416,91	BRDASADBS061	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	26/08/20	25/08/25	COSAN LO	824.572,00	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	24/11/20	04/11/25	BCBF	514.503,53	BRBCBFDBS040	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	24/11/20	04/11/25	BCBF	514.503,53	BRBCBFDBS040	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	499.332,30	BRSENGDBS001	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	1.014.903,04	BRSENGDBS001	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	999.679,50	BRSENGDBS001	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	1.756.246,44	BRDASADBS061	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	438.550,48	BRDASADBS061	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	26/08/20	25/08/25	COSAN LO	206.143,00	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	26/08/20	25/08/25	COSAN LO	515.902,85	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	24/11/20	04/11/25	BCBF	1.542.451,94	BRBCBFDBS040	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	551.751,49	BRBNBRLFI062	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	834.536,17	BRBNBRLFI062	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SBF COME	743.011,85	BRBFCDBS002	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SBF COME	1.779.042,45	BRBFCDBS002	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	02/10/20	15/09/25	BRKA	1.857.778,06	BRBRKPDBS048	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	02/10/20	15/09/25	BRKA	617.514,96	BRBRKPDBS048	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	17/05/18	25/04/23	CELPA	2.501.874,65	BREPADBS060	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	B2W	2.135.659,67	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	02/10/20	15/09/34	BRKA	959.091,67	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	16/11/20	15/10/36	PAMPASUL	2.323.858,08	BRUTPSDBS039	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/06/21	14/07/20	13/07/23	ECORODOV	2.098.074,35	BRERDVDBS007	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/06/21	28/06/13	15/05/23	LIGHT	2.086.442,40	BRLIGHDBS007	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	2.034.374,22	BROMGEDBS069	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/06/21	08/05/19	20/04/26	SMARTIFI	2.034.096,57	BRSMFTDBS045	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/06/21	23/10/19	30/09/23	USIMINAS	2.021.616,50	BRUSIMDBS005	brAAA	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/06/21	23/10/19	30/09/23	USIMINAS	505.404,12	BRUSIMDBS005	brAAA	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	723.173,74	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	1.028.556,78	BRRSANDBS030	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	503.964,42	BRRDVIDBS061	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/06/21	23/09/20	15/04/28	PAMPASUL	1.220.280,95	BRUTPSDBS005	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/06/21	22/06/21	15/06/31	RIO PR	480.244,46	BRRIPRDBS030	-	Aaa.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	04/12/20	27/11/25	GUAR	1.257.483,48	BRGUARDBS055	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAME	283.294,41	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.563.460,98	BRNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAME	1.468.505,73	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	85.452,32	BRNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.454.411,04	BROVSADBS0E8	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/06/21	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.621.447,80	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	04/12/20	27/11/25	GUAR	1.373.721,45	BRGUARDBS055	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.164.900,76	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	06/12/19	15/10/26	LIGHT	4.896.299,69	BRLIGHDBS055	brAAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.768.233,20	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.123.113,77	BRLRENDBS0B4	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	237.522,69	BRLRENDBS0B4	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.697.765,60	BRCACEDBS019	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	18/05/17	15/07/28	VENSJOR	313.974,87	BRVSHJDBS001	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	18/05/17	15/07/28	VENSJOR	1.514.761,72	BRVSHJDBS001	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	257.884,89	BRVAMODBS033	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	249.137,67	BRVAMODBS041	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.527.874,54	BRCACEDBS019	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	4.943.207,73	BRVAMODBS041	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/07/21	31/10/12	31/10/22	ITAÚ	1.305.631,56	BRBITALFIDB3	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/07/21	23/02/18	15/02/23	GETI	1.014.607,15	BRTIETHDBS093	-	Aa1.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/07/21	12/07/21	15/02/26	BRADESCO	3.079.383,38	BRBBCLTRQT4	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.134.186,46	BGRRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.874.555,46	BRI RBDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	213.954,97	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	293.496,11	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	910.498,36	BRI RBDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	B2W	1.668.805,15	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	02/10/20	15/09/34	BRKA	438.744,70	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	473.459,15	BRI RBDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	864.623,66	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	B2W	1.472.475,13	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	B2W	2.159.630,19	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	B2W	1.079.815,10	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	02/10/20	15/09/34	BRKA	732.300,93	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.800.172,84	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/10/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	281.408,75	BRVRDNBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	3.749.110,91	BRIRBRBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	06/04/21	15/03/29	ANET	1.039.000,89	BRANETDBS002	brA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/07/21	20/03/19	11/03/25	BRML	3.045.710,80	BRBRMLDBS076	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/07/21	06/06/18	10/05/24	MULTIPLA	3.095.843,79	BRMLTDBS031	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	368.659,29	BRIGADBS072	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	368.659,29	BRIGADBS072	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.314.350,51	BRIGADBS072	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	2.285.060,01	BRCRBDDBS033	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/07/21	28/06/18	15/05/23	ELEKTRO	554.985,49	BREKTRDDBS0F0	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/07/21	19/09/18	15/09/23	SONAE	3.011.051,86	BRALSCDDBS036	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.665.698,75	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	732.486,82	BRPASNDBS018	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.796.140,79	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAME	1.870.899,43	BRAMERDDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.857.557,90	BRUTPSDDBS013	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	680.668,24	BRUTPSDDBS013	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.284.732,76	BRIVADBS074	-	AA.br	-
FIM EMB I A	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.286.839,21	BRETENDBS061	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	22/01/21	15/01/26	AERIS	1.212.708,23	BRARIDBS006	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.098.479,31	BRCRBDDBS033	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.028.376,17	BROMGEDBS069	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.038.070,80	BRVAMODBS017	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.511.893,25	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/07/21	06/04/21	15/03/29	ANET	2.597.502,23	BRANETDDBS002	brA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	20/07/21	15/06/39	ANEMUS	544.471,87	BRANEMDDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	20/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.393.333,52	BRANEMDDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	16/04/21	15/06/28	MOVIDA L	1.441.711,67	BRMLVDBS050	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	16/04/21	15/06/28	MOVIDA L	3.662.491,67	BRMLVDBS050	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.386.442,62	BRBKBDRBS048	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.139.741,22	BRCOLNDBS0C7	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	996.553,31	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	02/08/21	28/01/21	15/01/31	ECHOENER	1.527.354,25	BRECHPDDBS024	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	951.135,79	BRUNEGDDBS007	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	04/08/21	23/04/21	15/04/27	MOV_PART	1.017.800,05	BRMOVDBS0E6	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	05/08/21	03/07/18	15/06/32	ENSINOP	675.968,43	BRCSNPDDBS022	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.011.474,57	BRMGPRDDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/08/21	10/08/21	10/08/23	PARANA B	508.342,79	BRPRBLFICE4	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.028.941,42	BRCSANDBS040	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.543.553,20	BRAPRDBS023	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	11/08/21	12/05/21	15/04/31	ELETROB	1.968.354,27	BRELETDDBS057	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	4.870.843,26	BRCSANDBS057	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/08/21	12/08/21	14/08/23	ABC	1.017.032,16	BRABCLF3Q1	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/08/21	12/08/21	15/07/31	ALGA	2.926.734,74	BRALGTDBS0F6	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	3.022.487,57	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.025.767,15	BRMGPRDDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.033.463,15	BRMGPRDDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/08/21	07/12/20	15/05/44	CTEEP	926.643,89	BRTRPLDDBS0D1	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/08/21	25/08/21	15/08/29	CEEE D	3.783.900,43	BRCEEDDBS019	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.025.655,28	BRRDORDBS0A0	AAA(bra)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/09/21	06/09/21	15/08/31	COMGAS	3.017.713,98	BRCGASDDBS0B7	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/09/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	491.242,16	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	665.574,60	BRGRRDDBS034	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	59.603,70	BRGRRDDBS034	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	298.018,48	BRGRRDDBS034	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	2.219.481,77	BRPRLGDDBS037	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	1.964.585,87	BRELETDDBS040	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	890.518,99	BRANHDBS0F3	brAAA	-	-
FIM EMB I A	17/09/21	04/10/18	01/10/24	EQUATENE	1.405.880,63	BREQLTDBS036	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	17/09/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	1.383.157,66	BRBRSTDBS001	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.045.682,37	BRMOVDBS0G1	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.465.798,57	BRMOVDBS0H9	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.007.928,84	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.007.928,84	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	969.381,45	BRMOVDBS0H9	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	06/08/19	15/07/39	EDPM	1.955.769,50	BRMGSPDDBS017	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	743.261,90	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	743.261,90	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	247.084,36	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	247.084,36	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	691.101,89	BRERVDDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	691.101,89	BRERVDDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	888.071,63	BRERVDDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	344.981,67	BRERVDDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	344.981,67	BRERVDDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.873.591,24	BRLOCAMDBS0R2	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.907.006,89	BRLOCAMDBS0R2	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	12/08/21	14/08/23	ABC	1.017.032,16	BRABCLF3Q1	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	24/09/21	05/04/21	15/03/24	CCPR	2.020.042,48	BRCCPRDDBS0D1	-	A.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	24/09/21	31/05/21	20/05/25	CEA MODA	2.073.037,00	BRCEABDDBS011	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	24/09/21	12/04/19	15/03/24	AMPL	2.019.679,30	BRCEEDDBS0D0	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	24/09/21	09/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.007.563,18	BRBPANLF654	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/09/21	28/05/20	28/05/23	IGUATEMI	2.365.111,40	BRIGADBS080	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/09/21	28/12/20	15/01/26	LOCAMERI	1.866.553,30	BRLOCAMDBS009	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/09/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	2.014.758,54	BRETENDDBS061	-	-	AAA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/10/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	10/08/21	10/08/23	PARANA B	1.016.685,58	BRPRBCLFICE4	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	1.868.939,92	BRCNHCLFI317	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	27/05/19	10/05/27	SABESP	1.165.828,49	BRSBSPDBS1B5	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMP PAR	764.397,44	BRSIMHDBS044	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/09/21	30/09/21	15/01/31	SIMP PAR	1.007.551,07	BRSIMHDBS036	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	01/10/21	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	1.740.098,05	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/10/21	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	1.787.771,96	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	543.117,87	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	4.983.328,20	BRTCIDBS009	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	19/10/21	15/06/20	15/06/30	ECHOENER	1.070.255,55	BRECHPDBS008	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.054.561,50	BRDAYCLFNKX1	-	-	-
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.151.145,07	BRDAYCLFNKX3	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.509.693,00	BRRTADBS033	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	1.505.815,80	BRRTADBS033	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	1.006.703,43	BRVIXLDBS047	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/10/21	20/07/21	15/06/39	ANEMUS	247.584,65	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/10/21	20/07/21	15/06/39	ANEMUS	250.800,03	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/10/21	20/07/21	15/06/39	ANEMUS	267.948,75	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/10/21	20/07/21	15/06/39	ANEMUS	247.584,65	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.211.517,73	BRCGPDBS014	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	755.580,36	BRHARGDBS003	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	6.004.612,16	BRHARGDBS003	brAAA	-	-
FIM EMB I A	28/10/21	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.200.806,45	BRBTOYLF12F4	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/10/21	20/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.071.795,02	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/10/21	29/10/21	15/10/31	ENERGISA	2.800.000,00	BRENGIDBS000	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/10/21	29/10/21	15/10/31	CELP	2.000.000,00	BRCEPEDBS007	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/10/21	29/10/21	15/10/31	ELEKTRO	2.000.000,00	BREKTRDBS0L8	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/10/21	29/10/21	15/10/31	COELBA	2.000.000,00	BRCEEBDBS019	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	4.920.591,65	BR0402CTF000	-	-	Aasf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	-	FIDC CELG DIST SN B	3.562.801,28	BRFCLGCTF015	-	-	AA-sf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	-	FIDC CREDZ SN4	13.868,46	BRCRDZCTF074	brAA(sf)	-	Asf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	1.676.797,15	BRCRDZCTF0A0	brAA (sf)	-	A+s(f)(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	-	FARM SYN AGRO FIDC	3.256.683,17	BR032XCTF002	-	-	AAAsf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	-	FIDC	3.001.074,47	BRNGSCTF002	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	-	SN3	5.110.446,23	BRVDCRCTF024	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	-	SN5	700.000,00	BRVDCRCTF040	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	-	SN6	1.400.000,00	BRVDCRCTF057	brAAA(sf)	-	-

Observação: Em outubro de 2021, nenhum dos ativos da carteira de crédito da EMBRAER PREV sofreu rebaixamento de suas classificações de risco e ficou abaixo do mínimo estabelecido na escala da Política de Investimentos de 2021.

4. RISCO OPERACIONAL

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

5. RISCO DE LIQUIDEZ

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



6. RISCO LEGAL

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

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Bradesco

Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **3.734.654.998,29**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.794.342.053,52	3.734.654.998,29	74,82%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	2.009.509.817,54	3.734.654.998,29	53,81%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	784.832.235,98	2.987.724.043,15	21,01%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	746.931.010,79	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	373.465.505,39	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	933.663.749,57	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	933.663.749,57	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	679.759.358,60	2.614.258.454,28	18,20%	Enquadrado
% do capital volante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	933.663.749,57	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	96.582.070,04	746.931.010,79	2,59%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	32.209.365,88	560.198.272,00	0,86%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	746.931.010,79	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	128.781.933,61	373.465.505,39	3,45%	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 OUTUBRO DE 2021 À 31 DE OUTUBRO DE 2021



FIM EMB I A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
11/10/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Compra	2,5990%	2,6510%	2,2222%	2,9556%	-0,0520%	NÃO
18/10/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Compra	3,1678%	3,1600%	2,7753%	3,5231%	0,0078%	NÃO
22/10/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Compra	3,6682%	4,0075%	3,2622%	4,4208%	-0,3393%	NÃO
22/10/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,4158%	5,4336%	5,2543%	5,7253%	-0,0178%	NÃO

FIM EMB II A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
01/10/2021	FIM EMB II A	BNP	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	3,7290%	3,7244%	3,4772%	4,1101%	0,0046%	NÃO
01/10/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Compra	3,7590%	3,7244%	3,4772%	4,1101%	0,0346%	NÃO
01/10/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Compra	3,7490%	3,7244%	3,4772%	4,1101%	0,0246%	NÃO
04/10/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Compra	3,7290%	3,7562%	3,4750%	4,1077%	-0,0272%	NÃO
15/10/2021	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/08/2040	Compra	5,0595%	5,1236%	4,9031%	5,3057%	-0,0641%	NÃO
15/10/2021	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/05/2045	Venda	5,0755%	5,1419%	4,9297%	5,3109%	-0,0664%	NÃO
18/10/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	4,7790%	4,8231%	4,4850%	5,0777%	-0,0441%	NÃO
18/10/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2030	Compra	4,9990%	5,0424%	4,7638%	5,2800%	-0,0434%	NÃO
21/10/2021	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/08/2040	Compra	5,2245%	5,3591%	5,0918%	5,4954%	-0,1346%	NÃO
21/10/2021	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/05/2045	Venda	5,2605%	5,3955%	5,1427%	5,5254%	-0,1350%	NÃO
28/10/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Compra	5,3990%	5,7280%	5,1076%	6,0295%	-0,3290%	NÃO
28/10/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,5095%	5,6761%	5,1877%	5,8915%	-0,1666%	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
01/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2055	Compra	5,0790%	5,0240%	4,9232%	5,2795%	0,0550%	NÃO
14/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TERRA	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,0940%	5,1199%	4,9389%	5,3048%	-0,0259%	NÃO
15/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/05/2045	Compra	5,0890%	5,1419%	4,9297%	5,3109%	-0,0529%	NÃO
18/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	HENCORP	NTN-B	15/05/2045	Compra	5,1590%	5,1771%	4,9726%	5,3541%	-0,0181%	NÃO
20/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	LFT	01/09/2022	Venda	0,0122%	0,0158%	-0,0378%	0,0830%	-0,0036%	NÃO
20/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	HENCORP	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,3310%	5,3290%	5,1190%	5,4867%	0,0020%	NÃO
21/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	ATIVA	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,0990%	5,2237%	4,8739%	5,4330%	-0,1247%	NÃO
21/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,2910%	5,4158%	5,1679%	5,5358%	-0,1248%	NÃO
21/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	HENCORP	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,3333%	5,4158%	5,1679%	5,5358%	-0,0825%	NÃO
21/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	PAULISTA	NTN-B	15/05/2055	Venda	5,3610%	5,4296%	5,1884%	5,5476%	-0,0686%	NÃO
22/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,3810%	5,4336%	5,2543%	5,7253%	-0,0526%	NÃO
25/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	HENCORP	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,3379%	5,4977%	5,2720%	5,7053%	-0,1598%	NÃO
27/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,3772%	5,4300%	5,1450%	5,6730%	-0,0528%	NÃO
27/10/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,3772%	5,4300%	5,1450%	5,6730%	-0,0528%	NÃO



7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

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

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

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

8. GLOSSÁRIO

Administrador

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

Carteira

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

Dados Gerais

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

Vide também glossário de *Value at Risk*, Patrimônio Líquido e *Expected Tail Loss*.



Duration

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

Vide também glossário de Valor Presente.

ETL (Expected Tail Loss)

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

Fundo de Investimento

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

Índice de Referência (Benchmark)

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

LDI (Liability Driven Investments)

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

Parâmetros do Cálculo do VaR (Value at Risk)

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

Patrimônio de Cobertura

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

Patrimônio Líquido (PL)

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



Rating

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

Stress Testing

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

Tracking Error

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

Túnel de Preços

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

Valor Presente

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

Value at Risk (VaR)

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