



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Setembro/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: 30/09/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.660.534.322,25	VAR / PL:	2,416%
VAR:	88.428.661,25	ETL / PL:	3,0294%
ETL:	110.893.146,75	VAR / CDI:	10198,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	192.180.936,09	BAIXA 1:	248.175.359,43	Cenário 1:	302.833.114,78
				Cenário 2:	- 67.991.676,70
				Cenário 3:	- 444.810.239,60

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
CJCT12	2.269,00	0,00	0,00	0,00%	-	-	-
CLSA3	1.267.590,00	125.885,73	55.562,13	-0,06%	-	-	-
CMIG4	647.948,82	116.171,69	1.470,17	0,00%	153.764,35	683,97	288.356,20
CNES11	584.364,00	14.308,25	2.726,82	0,00%	36.041,50	136,37	45.644,50
CNRD11	78.302,00	-	-	0,00%	-	-	-
COGN3	208.708,54	23.475,55	17.637,20	0,02%	65.494,07	222,20	64.673,53
CPFE3	7.788.284,80	1.150.770,08	154.122,16	-0,17%	1.240.452,85	5.265,94	2.070.584,55
CPLE6	466.195,25	38.789,37	15.608,28	-0,02%	66.899,51	281,46	109.225,19
CRFB3	1.582.868,30	80.806,57	33.684,13	0,04%	135.697,70	507,66	167.390,82
CSAN3	1.703.387,92	237.951,78	166.161,15	0,19%	68.517,05	261,91	88.881,09
CSED3	3.369.520,00	538.032,51	317.989,37	0,36%	-	-	-
CSNA3	735.307,12	178.971,25	38.594,41	0,04%	558.309,14	1.621,21	394.050,56
CURY3	70.080,00	8.930,90	7.363,09	0,01%	12.991,00	46,48	14.459,85
CVCB3	209.776,00	51.145,47	26.207,40	0,03%	23.324,95	96,38	36.441,63
CYRE3	928.216,60	135.835,70	94.772,80	0,11%	68.260,54	256,83	85.326,85
DXCO3	185.414,22	28.728,93	155,12	0,00%	-	-	-
ECOR3	132.996,50	15.166,40	10.710,85	0,01%	10.985,64	41,16	13.597,38
EIE3	388.772,35	26.858,02	2.108,82	0,00%	24.115,67	97,05	35.346,89
ELET3	2.767.431,02	237.887,84	142.400,72	0,16%	231.101,39	865,47	285.762,82
ELET6	7.964.441,94	655.053,67	358.148,76	0,41%	483.636,76	1.830,71	613.144,33
ENBR3	177.130,80	11.793,37	1.676,18	0,00%	9.353,92	37,46	13.552,40
ENEV3	4.409.463,24	390.734,71	218.538,02	0,25%	9.298,85	36,21	12.604,84
ENGI11	443.880,00	32.392,44	3.306,69	0,00%	9.548,74	37,63	13.313,11
EQTL3	12.438.029,00	792.536,06	104.012,12	0,12%	937.971,17	3.801,48	1.398.404,71
ESPA3	1.633.551,36	211.629,95	158.419,64	0,18%	-	-	-
EUCATEX PN	67.266,00	7.404,94	2.859,44	0,00%	6.007,26	22,44	7.381,75
EWJ_US	3.222.381,23	111.442,78	53.637,96	-0,06%	26.577,01	29.001,43	36.470,07
EZTC3	97.086,72	11.734,26	6.796,74	0,01%	12.656,27	46,39	14.892,11
FLRY3	278.413,95	22.392,80	3.418,57	0,00%	1.721,64	6,69	2.322,59
GALG11	1.001.286,00	33.109,97	7.998,41	0,01%	47.356,37	-	60.943,53
GGBR3	1.962.419,25	188.466,62	9.329,75	-0,01%	523.026,44	1.808,52	538.937,83
GGPS3	2.184.224,90	404.602,95	141.007,28	0,16%	-	-	-
GMAT3	3.418.371,00	204.814,33	18.141,14	0,02%	552.081,63	1.995,85	629.281,38
GNDI3	12.234.212,55	851.840,51	54.502,81	0,06%	205.241,78	793,55	273.486,11
GOAU4	345.694,08	32.847,63	1.684,30	0,00%	88.680,00	307,90	92.223,67
GOLL4	143.374,00	28.668,05	8.469,10	0,01%	9.407,38	37,93	13.851,26
HAPV3	20.043.312,80	1.536.211,71	44.249,94	-0,05%	108.025,96	420,03	145.868,80
HBRH11	2.385.752,80	-	-	0,00%	-	-	-
HBSA3	259.835,53	41.129,65	30.943,38	0,03%	93.392,35	311,25	88.644,65
HSML11	7.379.716,00	428.522,99	261.144,78	0,30%	109.589,80	424,12	146.355,78



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.660.534.322,25	VAR / PL:	2,416%
VAR:	88.428.661,25	ETL / PL:	3,0294%
ETL:	110.893.146,75	VAR / CDI:	10198,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	192.180.936,09	BAIXA 1:	248.175.359,43	Cenário 1:	302.833.114,78
				Cenário 2:	- 67.991.676,70
				Cenário 3:	-444.810.239,60

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
HYPE3	2.114.823,63	162.000,00	13.236,72	0,01%	289.177,40	1.056,96	- 338.029,27
IFCM3	4.073.700,00	748.229,85	234.449,60	0,27%	-	-	-
IGTA3	577.324,44	61.025,49	31.975,64	0,04%	206.924,50	689,88	- 196.574,20
INTB3	6.081.450,94	811.211,29	309.523,08	0,35%	-	-	-
IRBR3	249.991,14	17.553,07	10.280,32	0,01%	39.297,76	142,34	- 44.987,91
ITSA4	17.276.003,64	830.502,35	155.624,83	-0,18%	986.930,66	3.742,22	- 1.256.215,59
ITUB4	43.933.346,50	3.840.251,13	1.211.372,75	-1,37%	6.085.713,38	22.225,99	- 7.100.758,33
JBSS3	20.086.516,80	2.039.976,91	317.251,34	-0,36%	- 2.267.390,76	- 9.377,55	3.550.472,15
JHSF3	76.201,65	9.088,39	4.759,99	0,01%	23.446,69	79,74	- 23.278,59
JRDM11	1.112.675,10	58.010,02	3.814,48	0,00%	- 42.960,00	- 170,79	61.156,70
KLBN11	789.626,20	87.228,12	10.051,65	0,01%	62.295,90	233,80	- 77.417,41
LAME4	5.180.540,42	3.106.419,37	557.265,89	0,63%	1.298.835,88	4.520,37	- 1.358.044,94
LCAM3	1.128.753,14	114.275,58	87.803,23	0,10%	40.848,12	156,45	- 53.231,57
LJQQ3	216.710,00	34.179,71	14.100,29	0,02%	77.298,22	257,88	- 73.540,24
LREN3	15.517.275,76	851.785,35	583.932,12	0,66%	3.484.498,51	12.260,13	- 3.734.127,28
LVB11	3.976.842,96	186.287,85	50.950,99	0,06%	- 99.959,58	- 394,67	139.978,44
LWSA3	5.676.691,20	663.915,85	470.479,87	0,53%	820.680,06	2.989,18	- 951.643,91
MALL11	7.547.998,50	349.508,11	218.632,37	0,25%	- 118.193,65	- 464,43	163.632,49
MATD3	1.371.954,12	92.526,17	26.220,73	0,03%	-	-	-
MAXR11	1.496.259,20	128.896,97	19.386,25	-0,02%	- 115.063,15	- 466,71	171.873,59
MDNE3	79.860,00	9.304,77	6.232,21	0,01%	14.454,89	51,81	- 16.158,80
MGLU3	10.897.748,34	2.440.713,78	1.022.905,15	1,16%	4.822.040,65	15.576,68	- 4.273.715,86
MOVI3	8.202.600,00	1.334.376,28	926.698,48	1,05%	1.533.188,85	5.481,69	- 1.703.955,16
MRFG3	364.810,56	55.651,10	1.627,86	0,00%	- 101.219,99	- 461,92	202.549,85
MRVE3	378.310,24	62.579,78	35.757,51	0,04%	- 1.378,92	- 5,39	1.881,91
MULT3	1.780.259,08	133.453,62	78.413,58	0,09%	451.137,07	1.568,36	- 470.522,07
NEWU11	600.237,00	-	-	0,00%	-	-	-
NTCO3	22.698.219,96	3.059.373,32	1.323.879,90	1,50%	5.334.718,05	18.687,90	- 5.660.468,67
OMGE3	2.295.481,24	240.012,60	150.839,02	0,17%	- 62.067,09	- 245,30	87.116,58
ONCO3	255.780,00	40.483,33	1.125,33	0,00%	-	-	-
PACUCAR_CBD ON ED	164.600,52	12.951,87	5.900,87	0,01%	43.090,01	149,29	- 44.594,75
PARD3	524.058,70	104.727,03	1.101,45	0,00%	- 106.970,43	- 466,25	190.630,84
PATC11	8.029.415,10	312.250,66	145.405,86	0,16%	334.123,69	1.276,36	- 432.749,29
PETR3	29.534.385,78	2.836.460,08	978.500,43	-1,11%	2.124.120,67	7.998,05	- 2.659.898,75
PETR4	31.165.054,14	2.897.293,40	1.078.022,10	-1,22%	2.469.110,40	9.265,28	- 3.067.339,74
PETZ3	4.192.920,40	679.852,10	70.826,36	-0,08%	260.566,10	985,66	- 329.821,23
POWE3	75.400,00	-	-	0,00%	-	-	-
PRIO3	14.234.247,55	2.741.570,09	407.712,63	0,46%	- 2.913.590,16	- 12.703,76	5.196.723,16
PVBI11	3.050.714,88	256.565,03	34.932,65	0,04%	445.277,16	-	- 515.602,70
QAGR11	8.326.970,70	307.559,72	173.061,71	0,20%	13.415,21	-	- 18.195,34



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.660.534.322,25	VAR / PL:	2,416%
VAR:	88.428.661,25	ETL / PL:	3,0294%
ETL:	110.893.146,75	VAR / CDI:	10198,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	192.180.936,09	BAIXA 1:	248.175.359,43	Cenário 1:	302.833.114,78
				Cenário 2:	- 67.991.676,70
				Cenário 3:	-444.810.239,60

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
QUAL3	415.248,00	90.821,75	62.721,33	0,07%	2.704,46	10,51	3.647,06
RADL3	8.121.781,20	461.470,18	127.353,48	0,14%	325.283,87	1.243,53	422.044,57
RAIL3	12.183.557,52	1.014.047,51	773.382,86	0,87%	1.839.135,86	6.679,77	2.118.798,23
RAIZ4	393.680,00	-	-	0,00%	-	-	-
RAPT4	5.046.608,00	761.587,29	495.103,99	0,56%	690.119,42	2.522,42	806.694,97
RBGS11	619.226,40	32.167,83	17.216,94	0,02%	20.444,46	78,42	26.738,70
RBRL11	2.010.530,84	86.211,77	35.902,86	0,04%	-	-	-
RCRB11	1.701.243,12	118.590,31	65.095,88	0,07%	2.263,03	8,82	3.070,42
RDOR3	1.217.015,36	128.640,17	38.191,22	-0,04%	132.238,81	-	-
RECV3	474.832,00	92.205,01	40.695,15	0,05%	-	-	-
RENT3	5.362.215,00	614.810,44	463.624,49	0,52%	184.044,45	705,53	240.348,46
RNGO11	156.214,44	11.168,27	6.293,65	0,01%	336,70	1,31	458,71
SANB11	568.599,44	70.228,90	13.503,40	-0,02%	140.849,37	490,81	147.682,55
SBSP3	527.766,36	56.092,04	5.997,37	0,01%	25.509,55	101,93	36.753,98
SDIL11	374.886,72	17.482,87	9.031,76	0,01%	5.678,04	22,31	7.856,10
SEER3	348.217,53	61.918,55	31.913,07	0,04%	165.820,94	529,14	143.101,46
SMFT3	197.500,00	36.158,89	18.179,96	0,02%	-	-	-
SOMA3	1.348.069,11	227.340,67	60.025,42	0,07%	220.410,75	796,12	250.727,77
SPY	7.699.129,33	257.052,67	116.307,30	-0,13%	63.499,59	69.292,16	87.136,74
SQIA3	157.096,00	40.763,18	25.814,43	0,03%	54.863,44	183,56	52.530,32
STBP3	8.340.000,00	1.171.945,93	754.580,51	0,85%	1.439.728,61	5.179,54	1.622.872,70
SULA11	2.588.059,35	226.971,65	101.159,08	0,11%	307.839,07	1.134,23	366.552,74
SUZB3	17.422.668,00	2.532.036,60	405.465,96	-0,46%	461.814,07	1.777,10	608.505,12
SYNE3	178.363,00	6.516,52	758,21	0,00%	-	-	-
TAE11	328.215,75	25.884,70	8.844,13	-0,01%	47.596,70	173,33	55.167,00
TEND3	1.357.419,00	145.471,86	130.297,28	0,15%	286.697,02	1.014,44	311.186,17
TEPP11	7.937.485,50	730.384,87	309.498,51	0,35%	385.412,66	1.467,39	495.291,38
TIMS3	5.499.302,88	376.636,85	12.906,76	-0,01%	258.484,87	1.032,10	371.807,69
TOTS3	11.545.298,44	1.376.444,88	770.020,63	0,87%	408.440,20	1.621,10	579.141,93
TRXF11	13.398.918,75	270.363,53	87.915,42	0,10%	11.327,45	44,14	15.377,53
UGPA3	8.837.064,60	1.233.736,86	419.664,24	0,47%	1.663.614,72	5.944,57	1.846.475,53
USIM5	8.747.914,40	1.810.002,53	299.556,96	0,34%	3.856.700,50	12.465,68	3.422.552,73
VALE3	71.687.319,40	11.135.717,42	3.113.544,90	3,52%	27.712.565,62	91.404,00	25.708.753,87
VIIA3	528.404,22	148.944,85	11.317,57	-0,01%	-	-	-
VISC11	5.058,50	310,45	133,44	0,00%	418,38	1,57	517,79
VISC13	78,92	-	-	0,00%	-	-	-
VITT3	249.795,60	4.725.632,81	124.940,60	0,14%	-	-	-
VIVT3	769.317,40	44.946,18	25.936,99	-0,03%	9.784,43	37,91	13.099,40
VTV_US	6.716.447,36	232.281,50	111.798,23	-0,13%	55.394,79	60.448,03	76.015,00
VVPR11	1.302.160,00	-	-	0,00%	-	-	-
WEGE3	16.293.393,81	1.640.181,59	554.042,43	0,63%	2.645.415,61	11.250,26	4.435.190,01



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.660.534.322,25	VAR / PL:	2,416%
VAR:	88.428.661,25	ETL / PL:	3,0294%
ETL:	110.893.146,75	VAR / CDI:	10198,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	192.180.936,09	BAIXA 1:	248.175.359,43	Cenário 1:	302.833.114,78
				Cenário 2:	- 67.991.676,70
				Cenário 3:	- 444.810.239,60

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
WEST3	117.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
WSPZ21	4.664.837,03	133.734,73	58.079,92	-0,07%	38.473,86	41.983,53	52.795,41
XPIN11	1.898.888,40	63.116,18	40.901,77	0,05%	97.012,67	-	124.317,10
XPIN13	294.229,80	-	-	0,00%	-	-	-
XPIN14	2.842.600,00	-	-	0,00%	-	-	-
XPPR11	3.524.512,00	215.173,00	97.605,60	0,11%	82.824,00	-	109.510,01
YDUQ3	563.465,96	63.894,73	48.822,21	0,06%	112.010,20	398,44	123.048,22
INDV21	9.232.920,00	465.162,33	242.193,82	0,27%	-	-	-
WINV21	556.200,00	28.676,46	12.242,61	0,01%	-	-	-
DI1V21	38.690.823,14	787,06	330,13	0,00%	1.466,86	764,09	2.270,37
DI1F22	54.531.198,46	34.264,78	17.021,56	0,02%	152.928,37	79.404,28	235.428,74
DI1J22	1.250.636,12	1.831,74	1.011,02	0,00%	7.696,94	3.982,58	11.780,66
DI1N22	- 1.316.385,02	3.289,84	1.885,13	0,00%	- 12.913,44	6.659,09	19.653,28
DAPQ22	21.933.041,40	153.554,79	47.979,91	0,05%	68.862,93	25.137,72	152.317,99
DI1V22	550.676,27	1.974,84	1.146,31	0,00%	7.522,38	3.866,69	11.387,63
DI1F23	- 26.809.625,15	128.036,00	87.322,95	-0,10%	- 468.345,50	239.989,78	705.313,31
DAPQ23	29.003.465,35	336.149,29	150.486,70	0,17%	258.300,84	93.860,17	565.228,59
DI1N23	1.279.526,97	9.629,18	7.478,86	0,01%	32.488,25	16.543,27	48.416,89
DI1F24	16.936.819,66	187.119,51	155.544,76	0,18%	570.518,45	288.648,16	841.191,21
DI1N24	846.925,59	12.468,70	10.736,58	0,01%	35.553,78	17.875,77	51.879,67
DAPQ24	19.096.785,67	346.071,85	191.029,82	0,22%	367.579,42	132.539,44	789.898,97
DI1F25	7.147.848,87	132.522,51	116.148,51	0,13%	363.416,64	181.516,82	524.525,22
DAPQ25	8.446.862,41	179.106,13	114.293,20	0,13%	-	-	-
DI1F26	460.236,55	12.052,29	10.569,82	0,01%	31.392,83	15.481,36	44.365,29
DAPQ26	3.163.843,96	80.182,33	58.806,04	0,07%	-	-	-
DI1F27	8.680.960,64	292.572,74	258.152,78	0,29%	748.782,66	364.521,62	1.035.903,21
DAPQ28	- 5.187.347,09	157.761,45	125.859,77	-0,14%	-	-	-
DI1F29	6.801.953,23	332.059,84	292.859,33	0,33%	841.700,26	399.132,57	1.115.318,49
DAPQ30	- 16,38	0,55	0,48	0,00%	- 1,12	0,39	2,24
DI1F31	152.912,24	9.386,13	8.301,11	0,01%	24.904,13	11.502,61	31.612,23
DAPQ35	109.197,20	5.438,06	4.802,50	0,01%	-	-	-
WDOV21	- 1.246.254,80	43.106,32	20.753,50	0,02%	10.325,51	11.191,90	14.178,75
AFSV21	- 1.251.904,56	70.558,59	9.127,84	0,01%	- 37.591,50	11.267,14	49.332,79
CANV21	- 1.249.978,04	37.012,17	13.813,69	-0,02%	- 11.834,20	11.274,33	16.262,57
CHLV21	1.257.177,46	52.730,20	4.595,60	-0,01%	- 13.029,94	11.299,61	17.925,65
EUPV21	- 1.443.628,54	28.327,13	6.242,60	0,01%	5.302,50	13.110,93	7.236,90
NZLV21	846.960,27	31.067,98	535,34	0,00%	- 23.496,71	7.666,01	33.011,63
SWIV21	1.252.142,62	35.703,04	14.407,79	0,02%	- 19.008,89	11.285,19	26.301,00
MEXX21	768.761,92	31.558,38	1.294,76	0,00%	6.041,18	6.920,84	8.133,95
WDOX21	816.435,36	28.253,04	13.584,65	-0,02%	- 7.386,45	7.007,95	10.271,45



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.660.534.322,25	VAR / PL:	2,416%
VAR:	88.428.661,25	ETL / PL:	3,0294%
ETL:	110.893.146,75	VAR / CDI:	10198,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	192.180.936,09	BAIXA 1:	248.175.359,43	Cenário 1:	302.833.114,78
				Cenário 2:	- 67.991.676,70
				Cenário 3:	- 444.810.239,60

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
COMPROMISSADA	396.611.460,71	8.068,02	3.384,08	0,00%	15.036,51	7.832,49	23.273,10
EMP AÇÃO PROVISÃO	- 28.576,82	2,31	0,31	0,00%	6,98	3,64	10,80
DE252 AEGEA SA CDI -	1.057.040,84	66,92	21,35	0,00%	137,59	70,76	208,50
DE252 AERIS CDI - AER11	1.264.333,20	608,14	501,05	0,00%	1.948,83	985,95	2.873,54
DE252 ALIANSCE CDI -	3.993.967,83	25.916,43	22.799,35	0,03%	64.777,09	31.711,70	90.431,59
DE252 AMPL CDI - AMPLAO	2.051.296,46	1.278,95	1.031,76	0,00%	4.022,70	2.052,76	6.016,66
DE252 AUTOBAN CDI -	1.032.418,32	173,55	140,68	0,00%	535,66	270,23	786,14
DE252 AUTOPIST CDI -	1.511.059,74	330,81	281,51	0,00%	991,82	497,23	1.440,65
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.703.925,66	183,52	116,52	0,00%	568,69	290,46	851,90
DE252 BCBF CDI - BCBF14	267.853,59	96,89	77,80	0,00%	317,15	160,79	469,28
DE252 BCBF CDI - BCBF15	2.673.850,54	1.024,81	833,12	0,00%	3.334,86	1.689,43	4.928,16
DE252 BKBR CDI - BKBR18	1.476.089,95	271,10	205,00	0,00%	880,18	447,59	1.308,90
DE252 BRKA CDI - BRKP18	2.642.773,80	1.734,86	1.424,89	0,00%	5.572,54	2.820,87	8.224,33
DE252 BRML CDI - BRML17	3.146.365,62	3.516,25	3.062,51	0,00%	9.366,96	4.700,41	13.625,47
DE252 CCPR CDI - CCPRA3	2.131.235,67	2.096,83	1.786,53	0,00%	3.382,21	1.575,48	4.334,30
DE252 CEA MODA CDI -	2.158.306,64	664,62	530,89	0,00%	2.184,12	1.108,52	3.237,49
DE252 CELPA CDI - CELP15	2.599.300,20	160,91	39,11	0,00%	280,89	144,64	426,50
DE252 COELCE CDI -	4.222.206,93	16.710,31	14.362,56	0,02%	47.857,66	24.074,57	69.894,32
DE252 COPEL GT CDI -	293.146,05	351,68	262,43	0,00%	1.249,73	642,55	1.892,73
DE252 COPEL GT CDI -	292.261,39	244,70	204,15	0,00%	735,39	373,83	1.092,90
DE252 CORSAN CDI -	1.609.744,04	12.981,89	11.325,21	0,01%	34.047,49	17.008,33	49.125,54
DE252 COSAN LO CDI -	2.670.276,70	871,39	695,52	0,00%	2.856,74	1.449,23	4.231,35
DE252 CSAN CDI - CSAN23	1.133.073,64	2.540,62	2.244,90	0,00%	6.887,90	3.344,30	9.493,15
DE252 DASA CDI - DASAA2	2.695.630,10	349,87	248,39	0,00%	1.122,12	571,61	1.673,49
DE252 ECORODOV CDI -	1.840.640,04	19.670,34	17.292,41	0,02%	50.038,73	23.967,29	67.405,21
DE252 ECORODOV CDI -	2.153.924,12	289,46	163,59	0,00%	992,59	510,23	1.502,74
DE252 ELEKTRO CDI -	561.131,58	396,69	297,91	0,00%	1.364,86	700,49	2.060,89
DE252 ELETROB CDI -	2.113.768,62	1.218,01	1.043,50	0,00%	3.672,91	1.845,22	5.353,15
DE252 ENERG TR CDI -	7.522.251,78	95.710,94	84.210,28	0,10%	267.366,72	129.333,51	366.352,69
DE252 ENERSUL CDI -	988.689,79	240,76	146,15	0,00%	953,07	495,35	1.469,65
DE252 EQUATENE CDI -	1.481.694,59	255,21	190,32	0,00%	826,50	420,42	1.229,66
DE252 GETI CDI - TIET19	2.351.180,38	16.091,49	14.269,01	0,02%	42.406,88	19.836,30	54.963,86
DE252 GETI CDI - TIET27	3.057.957,67	167,44	17,17	0,00%	147,90	76,28	225,21
DE252 GUAR CDI - GUAR24	2.784.067,63	1.330,96	1.083,79	0,00%	4.348,66	2.203,90	6.430,55
DE252 GUARIROB CDI -	1.072.084,62	260,41	220,05	0,00%	787,36	396,04	1.149,91
DE252 IGUATEMI CDI -	2.392.087,88	242,18	120,98	0,00%	791,49	407,29	1.200,42
DE252 IGUATEMI CDI -	2.098.910,70	2.416,40	2.092,58	0,00%	6.692,48	3.378,26	9.830,88
DE252 INTERVIA CDI -	1.333.230,77	265,58	207,92	0,00%	859,84	436,43	1.274,71
DE252 LOCALIZA CDI -	1.150.376,63	121,79	50,82	0,00%	410,73	213,49	633,44
DE252 LOCAMERI CDI -	1.964.667,61	1.036,45	867,21	0,00%	3.241,73	1.636,84	4.764,35
DE252 MOV_PART CDI -	1.128.321,02	754,26	641,25	0,00%	2.320,80	1.166,23	3.384,11



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.660.534.322,25	VAR / PL:	2,416%
VAR:	88.428.661,25	ETL / PL:	3,0294%
ETL:	110.893.146,75	VAR / CDI:	10198,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 192.180.936,09	BAIXA 1:	248.175.359,43	Cenário 1:	302.833.114,78
				Cenário 2:	- 67.991.676,70
				Cenário 3:	- 444.810.239,60

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 MOV_PART CDI -	1.191.109,35	2.495,70	2.192,39	0,00%	6.912,32	3.403,54	9.747,32
DE252 MOV_PART CDI -	1.427.662,17	72,07	1,80	0,00%	0,01	-	0,01
DE252 MULTIPLA CDI -	3.156.378,50	2.530,71	2.144,94	0,00%	7.187,84	3.643,97	10.634,11
DE252 OMEGA GE CDI -	3.272.167,95	3.515,21	3.084,60	0,00%	9.930,98	4.908,74	14.093,11
DE252 OURO VER CDI -	2.207.791,84	1.450,93	1.234,22	0,00%	4.428,59	2.228,77	6.473,38
DE252 PROLAGOS CDI -	3.152.040,59	18.928,91	15.685,64	-0,02%	57.930,68	29.355,00	85.636,62
DE252 RD COLIN CDI -	3.263.191,55	28.937,16	25.384,31	0,03%	73.704,22	36.831,56	106.342,19
DE252 RENNER CDI -	1.394.347,24	280,15	213,67	0,00%	918,08	466,82	1.365,05
DE252 RT BANDE CDI -	3.404.011,71	2.075,33	1.783,65	0,00%	6.208,07	3.111,82	9.014,87
DE252 S LUIZ A CDI -	1.120.345,65	2.411,43	2.131,18	0,00%	6.539,09	3.174,65	9.011,07
DE252 SABESP CDI -	1.219.089,02	274,19	234,23	0,00%	815,36	408,58	1.183,43
DE252 SANEAMEN CDI -	2.621.473,88	853,75	686,41	0,00%	2.796,19	1.417,74	4.137,94
DE252 SBF COME CDI -	4.143.775,87	27.820,70	24.212,32	0,03%	75.495,70	38.186,51	111.161,95
DE252 SIMPAR CDI -	1.200.005,48	3.957,11	3.487,01	0,00%	10.747,91	5.240,79	14.916,54
DE252 SUL AME CDI -	1.327.624,63	194,13	123,29	0,00%	762,87	394,14	1.164,70
DE252 TELEF BR CDI -	5.053.314,28	15.159,10	8.237,93	0,01%	44.286,79	23.394,90	70.024,07
DE252 USIMINAS CDI -	3.437.080,25	5.803,16	4.271,66	0,00%	19.845,18	10.204,58	30.047,05
DE252 VAMOS CDI -	2.100.319,49	1.016,99	857,80	0,00%	3.144,95	1.584,24	4.604,27
DE252 VAMOS CDI -	297.374,38	849,98	750,04	0,00%	2.303,60	1.119,88	3.181,40
LF selic	8.024.743,25	5.047,70	4.289,12	0,00%	13.947,64	7.272,80	21.625,37
LF252 ABC CDI -	1.031.251,40	52,06	1,30	0,00%	0,01	0,00	0,01
LF252 ABC CDI -	1.031.251,40	52,06	1,30	0,00%	0,01	0,00	0,01
LF252 B.ALFA CDI -	1.003.602,47	50,66	1,26	0,00%	0,01	0,00	0,01
LF252 CNH CDI -	1.920.311,88	96,94	2,42	0,00%	0,01	0,00	0,02
LF252 PANAMERI CDI -	1.029.381,51	51,96	1,30	0,00%	0,01	0,00	0,01
LF252 PARANA B CDI -	1.555.133,67	78,51	1,96	0,00%	0,01	0,00	0,02
LFSN B VOTORA CDI -	2.293.405,95	143,86	7,23	0,00%	31,49	16,41	48,73
LFSN BRADESCO CDI -	3.389.060,56	171,08	4,27	0,00%	0,03	-	0,03
LFT	40.213.896,74	10.271,48	1.352,31	0,00%	0,30	-	0,41
CMTR33	5.307.111,25	56.619,65	11.718,88	0,01%	5.369,82	1.975,78	12.102,06
CRI RB CAPIT IPCA M D -	8.233.213,03	120.162,85	76.406,68	0,09%	149.899,00	53.375,21	299.414,96
DE252 AEGEA SA IPCA -	11.894.103,25	195.714,38	116.039,85	0,13%	229.442,19	82.691,24	471.682,34
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	5.020.301,19	72.923,68	38.296,88	0,04%	71.531,07	25.620,74	148.835,92
DE252 CEMIG - IPCA	2.547.977,32	32.471,65	16.015,78	0,02%	26.099,45	9.416,89	56.172,18
DE252 COM GAS IGPM-100 -	39.001.301,79	500.153,68	403.855,57	0,46%	1.382.773,33	32.945,50	2.746.115,85
DE252 CSAN IPCA -	5.532.158,11	131.733,08	109.338,99	0,12%	254.574,40	87.115,18	472.690,77
DE252 CSMG IPCA -	13.002.496,52	179.782,93	96.741,82	0,11%	181.741,72	65.343,83	376.034,93
DE252 DUKE GEP - IPCA	13.985.567,30	129.556,62	53.686,70	0,06%	85.191,24	30.958,90	186.458,12
DE252 ECORODOV IPCA -	10.385.222,81	166.716,18	97.777,53	0,11%	192.757,17	69.664,69	395.854,45
DE252 ECORODOV IPCA -	3.346.867,46	48.615,79	25.531,26	0,03%	47.687,38	17.080,50	99.223,95
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	3.012.977,95	29.568,36	8.770,95	0,01%	3.927,81	1.420,22	8.492,97



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.660.534.322,25	VAR / PL:	2,416%
VAR:	88.428.661,25	ETL / PL:	3,0294%
ETL:	110.893.146,75	VAR / CDI:	10198,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	192.180.936,09	BAIXA 1:	248.175.359,43	Cenário 1:	302.833.114,78
				Cenário 2:	- 67.991.676,70
				Cenário 3:	- 444.810.239,60

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 ECPT21	454.758,16	2.704,43	761,54	0,00%	70,95	26,27	162,29
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	602.414,38	4.045,72	1.255,41	0,00%	1.352,37	493,86	2.994,01
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	3.079.460,59	17.851,12	7.013,91	0,01%	3.444,64	1.248,26	7.485,60
DE252 IMED - IPCA	1.112.631,01	6.816,28	2.108,58	0,00%	533,59	196,07	1.117,23
DE252 IRB IPCA - IRBR12	13.638.651,86	254.850,90	178.646,25	0,20%	363.370,98	129.637,09	720.447,03
DE252 LIGHT IPCA - LIGHD7	5.374.269,94	96.241,96	65.628,24	0,07%	128.698,80	45.158,25	261.282,89
DE252 LIGHT IPCA -	4.702.284,39	38.750,12	15.629,41	0,02%	19.264,05	6.954,08	41.081,54
DE252 LOCALIZA IPCA -	8.665.131,07	212.231,13	176.839,35	0,20%	414.425,74	140.443,66	769.551,40
DE252 LOCAMERI IPCA -	10.107.542,52	242.205,87	203.880,87	0,23%	483.128,71	168.450,12	885.209,86
DE252 MOV_PART IPCA -	2.983.022,75	70.471,63	60.090,17	0,07%	144.458,75	51.622,66	260.496,17
DE252 MOVIDA L IPCA -	6.017.045,88	169.226,72	138.859,27	0,16%	308.801,86	108.946,42	630.777,45
DE252 PETR IPCA - PETR45	13.920.023,15	198.131,52	99.617,16	0,11%	189.235,07	67.985,33	399.872,85
DE252 RD COLIN - IPCA	8.308.908,98	49.547,25	21.149,06	0,02%	43.536,05	18.736,37	81.439,97
DE252 SABESP - IPCA	10.146.337,22	96.630,42	31.924,48	0,04%	25.369,46	9.211,21	55.404,06
DE252 SABESP IPCA -	14.039.993,18	214.920,84	116.942,41	0,13%	218.543,91	78.173,10	454.577,55
DE252 SIMPAR IPCA M D -	918.543,87	21.745,48	18.613,72	0,02%	44.946,33	16.166,32	80.702,82
DE252 TRANS AL - IPCA	15.575.837,08	162.503,15	80.807,62	0,09%	132.319,49	47.820,29	285.873,12
DE252 VAMOS IPCA -	6.075.179,86	140.211,85	117.164,01	0,13%	274.285,77	95.413,60	505.876,47
DEBI ALGA IPCA - ALGAB1	3.183.793,88	76.313,44	62.623,71	0,07%	143.791,44	48.194,44	270.889,10
DEBI ANEMUS IPCA -	2.220.720,13	58.090,74	49.175,95	0,06%	121.999,39	42.812,11	210.930,60
DEBI ANET IPCA - ANET11	6.586.171,70	117.677,42	80.523,06	0,09%	167.172,07	58.483,29	332.341,95
DEBI B2W IPCA - BTOW15	8.996.655,21	210.109,20	178.569,95	0,20%	424.840,15	149.575,84	770.275,47
DEBI BRISANET IPCA -	4.677.375,98	91.608,86	64.786,21	0,07%	134.207,53	47.107,18	266.558,12
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	8.085.838,40	205.592,32	170.380,22	0,19%	407.288,98	132.228,41	760.311,39
DEBI CAGECE IPCA -	8.719.017,94	191.426,46	101.715,94	0,12%	198.004,15	47.383,50	477.241,50
DEBI CEEE D IPCA - CEED21	4.092.502,21	91.603,24	72.963,68	0,08%	164.161,78	56.284,94	314.172,97
DEBI COM GAS IPCA -	3.279.209,46	79.369,59	65.419,91	0,07%	151.734,26	51.057,99	285.490,33
DEBI CORSAN IPCA -	6.428.724,97	136.461,83	102.869,12	0,12%	221.593,42	75.236,67	432.117,50
DEBI CTEEP IPCA - CTEE29	977.107,73	24.186,69	20.082,36	0,02%	48.874,40	15.986,94	84.957,59
DEBI ECHOENER IPCA -	1.692.945,16	32.684,38	23.896,99	0,03%	50.557,39	17.231,31	99.732,77
DEBI EDPM IPCA - MGSP12	1.969.993,12	45.035,06	35.995,06	0,04%	83.433,70	26.814,77	152.973,58
DEBI ELETROB IPCA -	2.183.460,97	52.351,93	43.447,57	0,05%	101.010,32	33.569,94	188.572,42
DEBI ELETROB IPCA -	11.926.318,61	251.552,73	193.998,58	0,22%	418.885,79	143.563,51	814.389,42
DEBI ENERGMIR IPCA -	1.014.177,40	16.752,95	10.891,43	0,01%	21.712,49	7.745,90	43.531,99
DEBI ENSINOP IPCA -	591.208,04	11.740,71	9.442,34	0,01%	21.748,94	7.839,78	40.007,94
DEBI ENTREVIA IPCA -	26.788.733,97	542.750,89	440.882,96	0,50%	1.004.209,65	360.499,96	1.870.932,11
DEBI IGUA SAN IPCA -	10.826.990,65	243.042,04	197.696,75	0,22%	460.205,45	158.701,62	845.622,51
DEBI JAGUARA IPCA -	1.679.449,26	26.863,37	17.203,02	0,02%	34.000,63	12.135,16	68.293,97
DEBI LAME IPCA - LAMEA6	9.322.952,52	210.573,38	179.421,82	0,20%	428.270,58	152.305,26	774.136,14
DEBI METRORIO IPCA -	9.668.542,07	213.538,34	167.583,96	0,19%	380.034,96	135.021,84	717.868,63
DEBI MG050 IPCA -	4.499.527,30	88.578,61	67.652,08	0,08%	148.632,81	51.727,31	284.383,08



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.660.534.322,25	VAR / PL:	2,416%
VAR:	88.428.661,25	ETL / PL:	3,0294%
ETL:	110.893.146,75	VAR / CDI:	10198,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	192.180.936,09	BAIXA 1:	248.175.359,43	Cenário 1:	302.833.114,78
				Cenário 2:	- 67.991.676,70
				Cenário 3:	- 444.810.239,60

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 NEOENERG IPCA -	5.896.525,94	130.857,10	100.043,60	0,11%	214.929,96	- 71.939,89	- 425.970,59
DEBI NORTE EN IPCA -	8.444.170,60	165.185,10	127.240,09	0,14%	279.874,57	- 100.027,65	- 532.064,86
DEBI PAMPASUL IPCA -	1.413.962,35	21.783,24	14.953,39	0,02%	30.116,14	- 10.654,80	- 59.550,58
DEBI PAMPASUL IPCA -	4.098.036,41	95.689,69	83.110,78	0,09%	206.114,17	- 72.856,49	- 354.932,30
DEBI PAMPASUL IPCA -	2.800.852,71	62.601,16	52.421,37	0,06%	122.824,74	- 41.844,13	- 225.308,51
DEBI PARANAGU IPCA -	715.077,98	11.958,79	8.482,53	0,01%	17.699,61	- 6.214,49	- 34.461,74
DEBI QUATA IPCA -	4.457.276,48	78.115,58	52.083,14	0,06%	103.674,81	- 37.342,83	- 207.334,60
DEBI RIO PR IPCA - RIPR22	529.918,39	12.501,91	10.178,83	0,01%	23.158,23	- 7.677,27	- 43.977,97
DEBI TAUBATE IPCA -	9.444.274,01	210.945,46	169.997,14	0,19%	403.442,23	- 134.065,17	- 740.180,18
DEBI UTE GNA IPCA -	1.067.629,79	31.369,93	26.858,13	0,03%	67.633,81	- 22.713,10	- 116.837,34
DEBI VENSJOR IPCA -	1.320.765,79	21.874,59	15.606,31	0,02%	33.442,34	- 12.287,44	- 64.212,38
DEBI VIARONDO IPCA -	10.142.099,72	235.293,68	192.433,84	0,22%	448.498,32	- 152.038,81	- 826.773,53
ECCR32	6.990.877,88	42.454,00	16.407,84	0,02%	12.990,69	- 4.723,30	- 28.460,58
LF ipca	1.324.190,37	9.986,81	5.219,44	0,01%	9.013,39	- 3.278,24	- 19.766,25
LFS ITAU IPCA -	5.093.057,41	35.846,34	11.206,36	0,01%	16.592,23	- 6.056,47	- 36.695,26
LFS ITAU IPCA M D -	802.017,64	6.451,78	2.371,80	0,00%	4.053,14	- 1.477,56	- 8.936,74
LFS ITAU IPCA M D -	4.010.088,18	32.258,92	11.859,02	0,01%	20.265,70	- 7.387,82	- 44.683,70
LFS ITAU IPCA M D -	9.624.211,64	77.421,41	28.461,64	0,03%	48.637,67	- 17.730,78	- 107.240,88
LFS ITAU IPCA M D -	7.218.158,73	58.066,06	21.346,23	0,02%	36.478,25	- 13.298,08	- 80.430,66
LFS ITAU IPCA M D -	5.614.123,45	45.162,49	16.602,62	0,02%	28.371,98	- 10.342,95	- 62.557,18
LFS ITAU IPCA M D -	8.033.186,07	65.725,27	24.666,27	0,03%	41.775,06	- 15.226,96	- 92.080,17
LFSN BRADESCO IPCA -	11.924.458,45	234.572,24	142.414,00	0,16%	274.763,85	- 98.806,99	- 586.751,73
LFSN BRADESCO IPCA M D -	3.854.749,32	82.091,93	54.169,95	0,06%	105.041,04	- 37.663,42	- 222.789,39
NTNB	1.838.822.833,67	63.186.890,13	60.483.023,64	68,40%	190.499.045,21	- 61.765.133,14	- 323.012.316,00
IBOVJ118	- 2.642,54	7.211,73	3.721,00	0,00%	- 143.257,62	- 98,14	2.642,52
IBOVJ124	- 1.701,35	4.290,11	2.213,54	0,00%	- 141.400,67	- 58,33	1.701,34
IBOVV110	27.701,34	36.749,98	18.962,45	-0,02%	- 27.615,44	- 495,98	251.045,72
IBOVV113	100.298,28	119.847,11	61.839,53	-0,07%	- 100.066,80	- 1.621,79	578.308,62
IDIJQF5	- 0,78	15,30	10,01	0,00%	- 13.269.418,15	1,50	1,50
IDIJQF6	35,15	540,93	353,94	0,00%	13.959.143,31	- 58,55	58,55
AB AMERICAN GROWTH	8.734.318,33	564.881,03	8.745,93	0,01%	- 1.499.424,05	- 78.608,87	98.852,73
BR ELETRO FIDC S1	5.014.843,46	13.605,54	790,45	0,00%	1.534.021,31	-	280.066,61
FARM SYN AGRO FIDC	4.039.591,03	60.427,44	19.033,43	-0,02%	- 72.037,44	-	64.917,26
FIDC CELG DIST SN B	3.681.992,67	35.630,42	4.715,59	-0,01%	216.625,13	1.067,64	353.895,39
FIDC CREDZ MZ4	845.882,49	3.831,23	938,41	0,00%	- 47.115,25	-	38.715,86
FIDC VERDECARD SM4	7.974.893,58	234.815,36	6.048,90	-0,01%	284.246,07	-	647.470,44
FII VIA PQ SHOPPING	1.594.252,91	-	-	0,00%	29.671,77	-	-
FUNDSMITH EQ FUND	10.253.395,98	554.225,68	111.478,97	-0,13%	512.732,44	- 92.280,56	116.045,26
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.303.183,56	222.601,41	21.934,19	0,02%	-	-	-
JANUS H GL FICFIA IE	3.820.655,62	126.647,86	12.084,92	0,01%	- 84.566,24	-	-
LOOMIS US GROWTH	7.437.768,87	440.181,91	63.804,01	-0,07%	-	- 66.939,92	84.178,73



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.660.534.322,25	VAR / PL:	2,416%
VAR:	88.428.661,25	ETL / PL:	3,0294%
ETL:	110.893.146,75	VAR / CDI:	10198,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	192.180.936,09	BAIXA 1:	248.175.359,43	Cenário 1:	302.833.114,78
				Cenário 2:	- 67.991.676,70
				Cenário 3:	-444.810.239,60

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
MFS MERIDIAN EUROPEA	5.604.234,00	290.932,20	- 165.228,20	-0,19%	-	50.438,11	63.427,26
PICTET GL FIC FIM IE	3.806.045,34	105.053,93	- 49.364,80	-0,06%	61.343,98	-	-
RB CAP CREDIT AL SN4	382.908,72	4.412,56	- 38,30	0,00%	46.221,66	-	-
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	3.214.533,37	38.265,74	- 8.240,42	-0,01%	-	-	-
WELLINGTON EM RESEAR	3.191.802,73	119.911,55	- 3.123,20	0,00%	-	28.726,22	36.123,99
WELLINGTON GLO QUAL	10.041.268,07	381.847,39	- 110.348,08	-0,12%	-	90.371,41	113.644,45
Total	4.028.301.468,49	169.755.182,70	88.428.661,25	1,00	302.833.114,78	- 67.991.676,70	-444.810.239,60



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

EMBRAERPREV RENDA FIXA CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	1.972.461.634,10	VAR / PL:	3,143%
VAR:	62.003.247,80	ETL / PL:	3,9420%
ETL:	77.754.600,84	VAR / CDI:	13271,02%

Cenários de STRESS

ALTA 1: - 166.509.094,60	BAIXA 1: 247.078.813,46	Cenário 1: 173.301.787,14
		Cenário 2: - 62.046.652,97
		Cenário 3: - 300.138.447,81

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	6.000,00	5,28	0,07	0,00%	54,29	0,21	74,57
RECEBER	105.073,58	92,49	1,17	0,00%	950,74	3,72	1.305,90
COMPROMISSADA	107.657.205,25	95.846,23	1.927,28	0,00%	970.046,53	5.938,21	1.331.696,78
CMTR33	5.311.613,71	54.959,92	14.261,56	0,02%	54.129,09	2.044,95	79.698,95
17H0164854	8.227.483,91	114.036,33	87.768,35	0,14%	76.037,01	53.808,49	198.172,64
AEGP23	11.886.721,16	186.207,35	136.605,26	0,22%	122.879,42	83.435,82	325.756,09
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	5.017.213,82	68.956,63	46.276,59	0,07%	26.644,86	25.963,53	87.516,20
CMDT33	2.547.460,66	30.828,43	19.320,27	0,03%	3.127,85	9.533,91	24.657,35
GASP17	38.971.611,63	487.720,95	422.945,00	0,68%	1.029.788,86	32.995,71	2.250.154,03
CSMGC3	12.996.464,75	170.647,81	115.829,84	0,19%	65.061,18	66.090,06	216.244,94
GEPA24	13.986.073,83	121.742,90	66.969,17	0,11%	40.947,65	31.599,77	13.471,61
ERDV17	10.379.699,93	158.510,78	115.440,00	0,19%	99.716,83	70.326,87	268.479,78
ERDV36	3.344.809,21	45.971,09	30.851,06	0,05%	17.763,24	17.309,02	58.344,13
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	3.014.778,10	29.261,99	10.144,00	0,02%	23.442,53	1.493,08	29.186,51
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	454.980,55	2.518,00	1.036,79	0,00%	4.199,11	14,30	5.842,29
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	602.928,50	3.870,14	1.516,44	0,00%	4.143,83	500,42	4.588,81
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	3.080.947,85	17.114,86	8.160,87	0,01%	24.398,19	1.371,54	30.707,89
SULM23	1.113.972,54	6.444,31	2.629,50	0,00%	9.579,81	223,53	12.800,15
DE252 PETR IPCA - PETR45	13.907.511,59	187.302,51	122.375,45	0,20%	64.845,14	68.940,37	229.911,71
RDCO34	8.308.057,97	45.378,78	26.294,01	0,04%	31.328,92	19.148,90	21.224,35
SBESC7	10.151.001,12	94.622,34	37.506,86	0,06%	66.677,44	9.497,37	71.216,44
SBSPC2	14.031.243,51	204.258,50	140.273,44	0,23%	92.520,12	78.960,49	281.861,01
TAE33	15.574.295,96	153.234,57	97.877,04	0,16%	7.635,01	48.718,57	94.356,56
ELET42	11.903.525,35	239.419,87	212.959,24	0,34%	312.781,57	144.218,09	669.156,16
ENMI21	1.013.344,29	15.956,86	12.507,73	0,02%	12.636,97	7.806,78	31.102,81
ENTV12	26.734.104,15	518.740,71	474.531,50	0,77%	765.921,51	362.002,52	1.544.045,66
IGSN15	2.264.609,47	48.689,54	44.693,22	0,07%	76.233,62	33.338,12	149.499,24
ENUG21	1.678.178,47	25.578,64	19.814,40	0,03%	18.963,48	12.234,33	47.698,24
NEOE16	5.885.126,70	124.799,97	110.771,52	0,18%	162.488,05	72.255,25	354.201,17
ECCR32	6.994.438,32	40.710,05	19.095,27	0,03%	50.363,36	4.950,02	58.572,42
LFS0120016V	5.092.246,82	34.482,38	13.150,72	0,02%	29.918,33	6.079,24	27.542,50
LFS012001GU	802.325,06	6.160,94	2.806,74	0,00%	3.257,85	1.487,42	1.146,35
LFS012001GZ	4.011.625,29	30.804,71	14.033,69	0,02%	16.289,27	7.437,09	5.731,75
LFS012001H2	9.627.900,69	73.931,30	33.680,85	0,05%	39.094,24	17.849,02	13.756,19
LFS012001H4	7.220.925,51	55.448,48	25.260,63	0,04%	29.320,68	13.386,77	10.317,15
LFS012001H6	5.616.275,40	43.126,59	19.647,16	0,03%	22.804,97	10.411,93	8.024,45
LFS012001IP	8.035.888,21	62.643,61	29.321,13	0,05%	31.383,14	15.349,90	8.764,02
LFSN16000GM	11.916.864,55	224.383,01	167.309,61	0,27%	167.954,62	99.587,27	440.703,52
LFSN1800DC5	3.852.339,14	78.706,28	62.305,88	0,10%	70.548,33	37.927,14	175.635,66
NTNB	1.709.180.504,82	59.269.599,58	59.235.350,83	95,54%	171.573.937,99	60.576.539,19	-294.397.064,93
Total	2.112.297.224,19	63.172.714,72	62.003.247,80	100,00%	173.301.787,14	- 62.046.652,97	-300.138.447,81



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	748.510.213,48	VAR / PL:	3,635%
VAR:	27.209.623,66	ETL / PL:	4,5587%
ETL:	34.121.977,50	VAR / CDI:	15346,99%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	624,16	BAIXA 1:	627,74	Cenário 1:	87.900.033,48
				Cenário 2:	294.501,83
				Cenário 3:	- 84.022.030,77

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	22.000,02	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	59.727.999,55	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	22.610.416,51	1.832.918,43	918.091,15	3,37%	3.263.318,83	11.887,33	- 3.785.014,54
ALPA4	264.000,00	43.848,13	26.875,21	0,10%	33.172,78	121,85	- 39.224,18
ALSO3	1.317.760,00	98.067,87	66.646,36	0,24%	351.367,89	1.214,90	- 362.017,56
AMER3	2.058.529,92	416.008,88	268.030,68	0,99%	-	-	-
ASAI3	8.771.442,40	863.577,36	325.408,70	-1,20%	-	-	-
AZUL4	5.730.934,00	446.151,18	79.299,54	0,29%	522.193,67	1.948,71	- 640.423,49
B3SA3	26.882.737,71	2.881.371,88	1.273.133,52	4,68%	3.483.905,02	12.774,80	- 4.102.612,86
UNT	19.586.858,73	1.865.640,84	1.672.643,87	6,15%	3.994.477,84	14.177,74	- 4.366.229,34
BBAS3	14.392.200,00	749.506,74	170.332,00	0,63%	993.341,44	3.745,39	- 1.247.862,95
BBDC3	731.902,80	53.017,64	33.709,65	0,12%	182.736,14	636,26	- 191.251,75
BBDC4	33.477.371,94	2.559.035,44	1.610.587,53	5,92%	8.868.138,79	30.684,53	- 9.151.548,76
BBRK3	17.160,00	5.299,45	3.761,82	0,01%	3.720,68	13,13	- 4.016,78
BBSE3	770.070,00	69.679,17	18.410,60	-0,07%	65.476,43	245,04	- 80.830,27
BEEF3	81.510,00	21.415,80	8.778,27	-0,03%	- 15.471,98	66,86	- 26.991,86
BIDI11	5.494.950,15	1.535.781,84	1.321.050,49	4,86%	2.099.267,41	6.935,92	- 1.954.876,78
BIDI3	938,96	162,40	97,43	0,00%	-	-	-
BIDI4	103.566,40	27.477,92	23.852,78	0,09%	40.005,89	131,97	- 37.122,26
BKBR3	70.606,00	9.815,99	7.320,26	0,03%	14.537,63	51,56	- 15.860,45
BMGB4	124.992,00	11.207,51	7.425,35	0,03%	32.491,89	112,65	- 33.683,46
BPAN4	3.233.496,00	401.920,75	343.465,10	1,26%	1.256.783,71	4.141,94	- 1.163.869,90
BRAP4	1.578.919,89	251.053,40	148.617,74	0,55%	469.699,28	1.603,90	- 470.595,01
BRDT3	3.539.214,81	403.698,59	335.653,02	1,23%	613.766,95	2.207,32	- 691.298,79
BRFS3	660.996,00	93.140,04	33.093,95	-0,12%	- 25.501,89	101,38	36.302,53
BRKM5	474.720,00	94.087,37	41.584,30	0,15%	- 56.701,70	235,36	89.574,92
BRML3	4.908.834,32	321.620,21	199.820,64	0,73%	1.316.720,69	4.549,76	- 1.354.646,18
CASH3	100.968,00	55.645,17	26.986,13	0,10%	71.401,42	-	- 52.154,10
CCRO3	5.482.620,00	316.419,42	205.533,11	0,76%	672.247,64	2.472,78	- 797.401,21
CESP6	9.892.542,78	585.954,79	75.281,93	-0,28%	- 566.965,11	2.276,01	826.092,58
CIEL3	3.122.873,00	407.143,29	256.609,79	0,94%	1.968.126,64	5.955,85	- 1.515.451,64
CLSA3	1.267.590,00	123.962,12	6.444,23	0,02%	-	-	-
CMIG4	468.293,34	81.747,87	31.294,24	-0,12%	- 104.884,08	462,71	192.647,58
COGN3	149.592,00	16.352,67	11.871,47	0,04%	46.878,48	159,07	- 46.308,78
CPFE3	7.658.892,00	1.105.545,37	263.122,92	-0,97%	- 1.089.621,68	4.580,99	1.775.956,79
CPLE6	339.248,00	27.530,15	13.598,84	-0,05%	- 47.314,19	198,60	76.818,00
CRFB3	1.536.879,36	79.247,33	6.584,32	0,02%	125.220,80	469,39	- 155.180,01
CSAN3	799.704,00	109.374,33	23.200,57	0,09%	18.540,55	71,46	- 24.523,24
CSED3	3.282.000,00	508.282,16	427.854,53	1,57%	-	-	-
CSNA3	551.616,00	132.090,01	80.886,58	0,30%	399.272,00	1.172,32	- 288.427,18



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	748.510.213,48	VAR / PL:	3,635%
VAR:	27.209.623,66	ETL / PL:	4,5587%
ETL:	34.121.977,50	VAR / CDI:	15346,99%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	624,16	BAIXA 1:	627,74	Cenário 1:	87.900.033,48
				Cenário 2:	294.501,83
				Cenário 3:	- 84.022.030,77

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CVCB3	146.336,00	34.885,81	32,04	0,00%	15.820,54	65,26	24.615,86
CYRE3	878.958,00	126.437,10	43.159,43	0,16%	73.338,19	274,66	90.691,43
DXCO3	139.154,00	22.506,41	14.051,62	0,05%	-	-	-
ECOR3	96.984,00	10.814,52	2.049,32	0,01%	8.266,03	30,93	10.202,11
EGIE3	292.188,00	19.677,40	2.308,44	-0,01%	16.754,61	67,26	24.413,10
ELET3	2.613.789,23	228.973,98	18.802,26	0,07%	186.381,38	701,99	233.550,28
ELET6	7.775.479,36	651.763,51	8.696,09	0,03%	385.538,65	1.467,14	494.882,69
ENBR3	132.192,00	8.581,08	1.501,75	-0,01%	6.081,87	24,27	8.737,44
ENEV3	3.766.689,00	340.042,25	6.510,74	-0,02%	33.623,57	131,67	46.176,95
ENGI11	324.934,00	23.208,66	1.829,22	-0,01%	5.469,32	21,50	7.582,64
EQTL3	11.417.589,30	705.414,02	71.140,27	-0,26%	784.460,58	3.168,04	1.159.569,05
ESPA3	1.594.201,49	227.968,48	154.307,91	0,57%	-	-	-
EUCATEX PN	65.860,00	7.230,61	921,43	0,00%	6.800,57	25,24	8.232,75
EZTC3	68.520,00	8.420,81	3.970,59	0,01%	9.834,21	35,84	11.415,77
FLRY3	203.504,00	16.190,08	614,52	0,00%	2.914,40	11,28	3.894,53
GGBR4	1.704.590,00	162.092,85	53.142,32	0,20%	427.153,92	1.486,71	446.677,78
GGPS3	2.184.224,90	389.521,46	266.657,85	0,98%	-	-	-
GMAT3	3.568.217,40	257.532,76	57.030,56	0,21%	505.657,09	1.844,11	588.067,83
GNDI3	11.880.150,30	839.663,33	239.027,14	0,88%	294.153,08	1.132,89	388.366,16
GOAU4	260.820,00	24.500,79	9.181,49	0,03%	62.484,82	218,47	66.017,45
GOLL4	110.839,92	21.977,26	6.337,89	-0,02%	7.498,45	30,27	11.069,16
HAPV3	18.926.711,47	1.495.277,05	361.181,56	1,33%	309.208,41	1.195,79	412.232,04
HBSA3	264.711,80	40.669,11	25.845,54	0,09%	91.961,34	307,90	88.189,40
HYPE3	1.961.182,80	154.467,11	83.293,29	0,31%	273.920,65	999,89	319.231,00
IFCM3	4.073.700,00	741.551,24	400.121,50	1,47%	-	-	-
IGTA3	548.796,00	55.685,08	28.471,52	0,10%	184.003,40	618,99	178.312,95
INTB3	6.042.678,54	794.114,64	66.828,62	-0,25%	-	-	-
IRBR3	180.686,00	13.231,15	7.588,25	0,03%	29.282,91	105,84	33.358,83
ITSA4	16.556.268,00	773.602,89	369.854,59	1,36%	991.257,75	3.753,73	1.257.883,40
ITUB4	42.344.754,22	3.591.875,86	1.449.623,05	5,33%	5.994.244,75	21.862,27	6.972.267,06
JBSS3	19.365.368,01	2.139.162,24	1.026.805,90	-3,77%	2.475.688,76	10.324,26	3.955.798,22
JHSF3	55.648,00	6.495,84	3.998,46	0,01%	16.502,64	56,37	16.547,84
KLBN11	585.882,00	64.654,06	33.433,23	0,12%	53.215,59	198,62	65.284,39
LAME4	4.852.776,00	2.852.929,61	480.152,97	-1,76%	1.238.403,85	4.302,09	1.289.481,37
LCAM3	1.050.809,69	102.884,26	41.808,17	0,15%	33.971,95	130,36	44.465,71
LTRE3	14.050.140,74	744.758,21	528.789,21	1,94%	3.090.107,34	10.893,65	3.326.106,42
LWSA3	5.845.840,00	658.432,20	549.446,81	2,02%	842.419,23	3.068,99	977.316,11
MATD3	1.371.954,12	92.048,40	38.790,48	0,14%	-	-	-
MDNE3	78.870,00	9.925,94	8.460,97	0,03%	15.597,09	55,51	17.151,31
MGLU3	9.977.772,00	2.239.307,54	1.697.397,96	6,24%	4.471.732,88	14.415,05	3.945.286,58
MOVI3	8.093.925,00	1.287.464,60	841.854,50	3,09%	1.408.273,68	5.063,37	1.585.265,13



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	748.510.213,48	VAR / PL:	3,635%
VAR:	27.209.623,66	ETL / PL:	4,5587%
ETL:	34.121.977,50	VAR / CDI:	15346,99%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	624,16	BAIXA 1:	627,74	Cenário 1:	87.900.033,48
				Cenário 2:	294.501,83
				Cenário 3:	-84.022.030,77

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
MRF3	277.128,00	47.197,49	25.988,47	-0,10%	80.355,65	369,73	164.209,55
MRVE3	176.976,00	28.629,04	1.524,63	0,01%	1.322,61	5,14	1.781,58
MULT3	1.538.918,04	111.543,12	65.101,23	0,24%	377.470,15	1.316,68	396.681,85
NTCO3	21.150.404,11	2.787.665,25	2.158.008,53	7,93%	5.034.658,08	17.614,62	5.326.951,15
OMGE3	2.321.533,36	236.711,98	15.172,51	0,06%	60.390,39	238,55	84.657,74
PACUCAR_CBD ON ED	123.552,00	9.256,97	4.682,84	0,02%	31.498,11	109,43	32.805,05
PARD3	533.021,00	109.182,29	12.377,19	0,05%	90.497,22	386,52	153.341,94
PETR3	28.452.274,71	2.620.341,83	869.963,14	3,20%	2.044.637,38	7.698,98	2.560.530,42
PETRA	29.616.573,36	2.655.252,38	814.069,01	2,99%	2.371.663,45	8.896,07	2.943.554,27
PETZ3	3.643.338,00	611.744,46	294.386,52	1,08%	300.727,02	1.126,73	372.246,21
POWE3	75.400,00	-	-	0,00%	-	-	-
PRI03	15.367.659,30	3.229.708,04	1.058.415,09	-3,89%	3.349.538,02	14.722,58	6.095.760,08
QUAL3	345.827,00	73.558,02	8.599,69	0,03%	1.043,44	4,06	1.412,90
RADL3	7.226.004,00	446.868,06	176.887,34	0,65%	362.401,91	1.378,72	464.887,89
RAIL3	11.823.803,43	1.000.724,74	672.118,99	2,47%	1.787.162,52	6.490,43	2.058.509,11
RAPT4	5.178.488,00	775.387,44	92.813,18	0,34%	604.277,47	2.228,73	721.233,73
RDOR3	651.936,00	67.077,52	14.992,23	0,06%	65.774,72	-	-
RECV3	474.360,00	91.966,83	4.764,55	0,02%	-	-	-
RENT3	4.660.834,49	518.846,31	143.827,00	0,53%	134.760,91	517,96	177.077,46
SANB11	417.366,00	52.936,50	27.809,25	0,10%	109.595,87	379,57	113.339,05
SBSP3	393.414,00	42.368,09	15.445,59	-0,06%	20.964,66	83,98	30.392,84
SEER3	350.331,60	58.400,19	44.895,68	0,16%	157.675,87	507,93	138.902,12
SOMA3	1.360.864,65	220.594,14	146.355,13	0,54%	215.839,34	781,29	246.740,95
STBP3	8.267.025,00	1.131.474,29	392.107,01	1,44%	1.261.575,41	4.578,71	1.450.978,40
SULA11	2.491.001,24	225.885,54	125.249,77	0,46%	323.303,62	1.185,39	380.643,36
SUZB3	16.834.467,52	2.458.028,07	656.518,02	2,41%	788.136,47	3.003,18	1.014.808,65
SYNE3	178.017,00	6.910,43	4.010,53	0,01%	-	-	-
TAEE11	236.544,00	18.279,50	5.086,65	0,02%	33.607,55	122,55	39.070,17
TEND3	1.368.297,00	144.589,73	95.974,35	0,35%	290.188,77	1.026,42	314.711,75
TIMS3	5.363.875,00	381.408,58	29.482,58	0,11%	175.753,19	696,63	248.411,79
TOTS3	11.522.506,30	1.435.230,09	1.022.369,57	3,76%	205.776,68	809,47	285.639,77
UGPA3	8.210.238,96	1.164.946,06	68.771,64	-0,25%	1.330.486,89	4.808,74	1.515.698,44
USIM5	8.962.720,00	1.810.640,46	826.242,12	3,04%	3.750.735,79	12.223,80	3.389.237,41
VALE3	68.857.833,30	10.685.443,04	7.357.297,37	27,04%	26.335.945,54	86.998,93	24.515.643,61
VIIA3	370.080,00	106.133,10	61.002,59	0,22%	-	-	-
VITT3	249.795,60	4.611.751,54	1.861.909,43	-6,84%	-	-	-
VIVT3	574.458,00	32.848,80	6.277,09	-0,02%	10.216,88	39,48	13.598,16
WEGE3	15.554.775,00	1.565.591,12	430.807,87	-1,58%	2.605.992,17	11.115,83	4.401.494,38
WEST3	117.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
YDUQ3	534.600,00	58.575,58	26.373,32	0,10%	102.112,32	364,44	113.030,58
COMPROMISSADA	24.347.197,33	500,31	270,57	0,00%	921,82	480,18	1.426,79
EMP AÇÃO PROVISÃO	59.301,25	5,15	2,91	0,00%	16,37	8,52	25,31
Total	766.881.779,01	82.224.941,88	27.209.623,66	100,00%	87.900.033,48	294.501,83	-84.022.030,77



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIRF EMB II CNPJ - 11005764000196

Dados Gerais

PL:	1.786.782.421,26	VAR / PL:	3,597%
VAR:	64.270.664,64	ETL / PL:	4,5108%
ETL:	80.598.034,00	VAR / CDI:	15185,87%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	162.909.248,16	BAIXA 1:	243.005.578,12	Cenário 1:	134.441.594,11
				Cenário 2:	- 61.412.145,75
				Cenário 3:	- 243.417.288,27

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	5.000,00	18,01	10,06	0,00%	- 142,04	- 0,56	199,70
RECEBER	- 63.175,13	227,49	127,09	0,00%	1.794,66	7,10	- 2.523,15
COMPROMISSADA	106.707.139,94	384.221,45	215.333,81	0,34%	- 3.027.260,92	- 14.092,92	4.255.524,89
GASP17	32.290.763,18	446.582,83	406.310,59	0,63%	228.127,21	- 29.822,87	- 976.074,19
CSMGC3	12.996.464,39	198.526,09	142.412,14	0,22%	- 186.541,20	- 67.089,65	141.295,93
DE252 PETR IPCA - PETR45	13.907.511,21	216.206,93	150.647,41	0,23%	- 204.394,47	- 70.010,03	152.692,63
SBESC7	9.920.296,29	115.486,25	58.461,28	0,09%	- 257.211,98	- 10.044,51	342.511,44
SBSPC2	7.943.589,42	132.127,94	95.499,81	0,15%	- 101.403,33	- 45.313,32	58.961,51
ELET42	11.903.525,02	262.192,19	235.022,90	0,37%	82.337,71	- 145.133,62	- 341.682,72
ENTV12	11.550.287,88	246.463,60	226.481,22	0,35%	107.305,75	- 157.289,09	- 349.338,78
IGSN15	2.264.609,40	53.019,23	48.864,07	0,08%	32.392,37	- 33.512,29	- 87.198,41
NEOE16	5.885.126,54	135.845,04	121.548,56	0,19%	48.556,15	- 72.707,89	- 192.297,64
LFS0120016V	5.092.246,68	47.069,33	24.173,64	0,04%	- 128.500,63	- 6.470,89	167.633,39
LFS012001GU	802.325,03	8.072,98	4.520,72	0,01%	- 18.790,30	- 1.549,13	23.218,81
LFS012001GZ	4.011.625,17	40.364,88	22.603,59	0,04%	- 93.951,50	- 7.745,64	116.094,07
LFS012001H2	9.627.900,42	96.875,72	54.248,63	0,08%	- 225.483,60	- 18.589,53	278.625,76
LFS012001H4	7.220.925,31	72.656,79	40.686,47	0,06%	- 169.112,70	- 13.942,15	208.969,32
LFS012001H6	5.616.275,24	56.510,84	31.645,03	0,05%	- 131.532,10	- 10.843,89	162.531,69
NTNB	1.709.180.457,67	62.402.726,95	62.392.321,79	97,08%	138.485.405,05	- 60.707.994,87	-247.376.432,52
Total	1.956.862.893,68	64.915.194,54	64.270.664,64	100,00%	134.441.594,11	- 61.412.145,75	-243.417.288,27



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FI RF EMB V CREDITO PRIVADO CNPJ - 20726178000121

Dados Gerais

PL:	185.679.212,84	VAR / PL:	1,022%
VAR:	1.898.320,20	ETL / PL:	1,2821%
ETL:	2.380.570,94	VAR / CDI:	4316,23%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	4.694.370,65	BAIXA 1:	3.166.736,39	Cenário 1:	2.383.130,13
				Cenário 2:	- 779.504,73
				Cenário 3:	-4.818.425,90

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	- 41.898,45	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	950.062,36	19,52	2,46	0,00%	35,97	18,74	55,68
CMTR33	5.311.613,71	55.817,74	38.023,24	2,00%	6.067,63	2.233,18	13.684,14
17H0164854	8.227.483,91	117.365,28	117.158,26	6,17%	150.482,36	53.516,94	300.427,01
AEGP23	11.886.721,16	191.702,43	190.547,97	10,04%	230.434,91	83.014,60	473.488,89
CGRDD1	5.017.213,82	71.426,85	70.743,22	3,73%	72.042,48	25.785,74	149.872,09
CMDT33	2.547.460,66	31.929,75	31.332,46	1,65%	26.178,22	9.443,64	56.318,18
100 - GASP17	6.680.847,55	83.386,82	51.953,61	2,74%	236.986,03	5.419,66	468.772,86
GEP24	13.986.073,82	127.386,55	121.484,80	6,40%	85.603,56	31.104,15	187.295,98
ERDV17	10.379.699,92	163.337,92	162.345,21	8,55%	193.636,23	69.959,05	397.482,74
ERDV36	3.344.809,21	47.617,90	47.162,15	2,48%	48.028,32	17.190,49	99.914,72
ECPT11	3.014.778,10	29.877,34	23.133,86	1,22%	3.836,31	1.386,24	8.282,33
ECPT21	454.980,55	2.659,15	2.215,80	0,12%	82,28	30,43	187,61
ECPT31	602.928,50	3.987,20	3.286,35	0,17%	1.311,69	479,05	2.904,63
ECPT41	3.080.947,85	17.810,29	15.015,07	0,79%	3.479,37	1.262,36	7.583,33
SULM23	1.113.972,54	6.735,81	5.670,67	0,30%	499,82	184,05	1.044,73
RDCO34	8.308.057,97	48.568,48	46.496,82	2,45%	43.845,49	18.854,50	82.031,43
SBESC7	230.704,56	2.206,50	1.824,90	0,10%	572,10	207,67	1.248,73
SBSPC2	6.087.653,87	91.514,02	90.949,57	4,79%	95.224,53	34.042,40	197.949,13
TAEE33	15.574.295,95	160.105,33	157.480,87	8,30%	133.287,03	48.166,67	287.919,98
ENMI21	1.013.344,29	16.375,17	16.288,22	0,86%	21.806,09	7.770,87	43.697,05
ENTV12	15.183.815,94	298.287,47	279.227,15	14,71%	572.399,15	205.063,73	-1.065.661,59
ENJG21	1.678.178,46	26.277,34	26.178,78	1,38%	34.148,26	12.174,87	68.555,30
ECCR32	6.994.438,32	42.247,59	36.188,38	1,91%	12.924,93	4.702,16	28.357,18
LFS012001IP	8.035.888,21	64.715,85	57.363,42	3,02%	41.328,58	15.065,14	91.109,13
LFSN16000GM	11.916.864,54	230.052,03	227.327,19	11,98%	275.782,86	99.164,98	588.810,96
D - LFSN1800DC5	3.852.339,14	80.412,89	78.924,69	4,16%	105.405,74	37.790,63	223.514,03
Total	155.434.276,47	2.011.823,22	1.898.320,20	100,00%	2.383.130,13	- 779.504,73	-4.818.425,90



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIM EMB I A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	222.295.375,55	VAR / PL:	0,439%
VAR:	976.369,23	ETL / PL:	0,5508%
ETL:	1.224.406,83	VAR / CDI:	1854,31%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	67.019,55	BAIXA 1:	354.522,32	Cenário 1: -	665.279,03
				Cenário 2: -	116.739,43
				Cenário 3:	1.571.200,50

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,06	7,92	6,26	0,00%	- 81,44	- 0,32	111,86
RECEBER	- 20.341,12	17,91	14,14	0,00%	184,05	0,72	- 252,81
AMER3	489.185,32	98.971,21	71.829,36	7,36%	- 4.426,33	- 17,33	6.079,79
BRIT3	257.992,00	46.301,01	26.990,68	2,76%	- 2.334,41	- 9,14	3.206,43
CASH3	289.682,00	159.799,66	101.685,39	10,41%	202.232,93	- 10,27	- 146.032,31
CBAV3	283.794,00	53.919,36	21.148,22	-2,17%	- 2.567,87	- 10,06	3.527,10
CSAN3	611.268,00	83.590,03	25.027,72	2,56%	8.640,82	32,96	- 11.147,70
CURY3	69.216,00	8.553,53	4.596,35	0,47%	11.576,85	41,38	- 12.845,03
ENEV3	438.102,00	39.348,91	4.222,59	-0,43%	- 7.874,85	- 30,84	10.815,72
EQTL3	572.910,00	35.077,90	9.486,78	-0,97%	- 44.546,44	- 179,27	65.305,02
HAPV3	914.607,00	72.256,74	12.039,52	1,23%	6.666,36	25,37	- 8.553,45
LAME4	224.496,32	131.848,02	29.791,55	-3,05%	55.259,00	191,07	- 56.863,11
LJQQ3	211.250,00	33.657,79	30.608,55	3,13%	74.521,45	247,01	- 69.774,85
LREN3	1.101.440,00	58.810,36	41.929,40	4,29%	232.278,15	814,96	- 247.056,07
MGLU3	767.577,18	172.864,17	155.337,72	15,91%	337.059,34	1.081,73	- 293.966,08
MRVE3	192.953,00	31.115,38	60,27	-0,01%	- 303,90	- 1,24	455,67
MULT3	201.718,00	14.712,40	8.998,31	0,92%	47.652,74	165,44	- 49.489,16
NTCO3	1.266.846,00	167.913,46	148.973,20	15,26%	290.098,08	1.010,17	- 303.323,60
ONCO3	242.460,00	42.333,30	24.863,15	2,55%	- 2.193,87	- 8,59	3.013,39
PETZ3	410.550,00	69.131,42	28.529,02	2,92%	30.172,65	112,42	- 36.844,14
RADL3	380.931,00	23.597,06	6.789,20	0,70%	15.657,82	59,18	- 19.772,99
RAIZ4	393.680,00	346,53	273,63	0,03%	- 3.562,16	- 13,95	4.892,81
RDOR3	359.923,00	37.199,62	8.958,58	0,92%	33.056,41	- 12,75	4.473,26
RENT3	321.373,00	35.734,95	12.647,67	1,30%	6.384,11	24,33	- 8.215,66
SMFT3	202.240,00	36.631,54	27.580,55	2,82%	- 1.829,94	- 7,17	2.513,52
SQIA3	154.468,00	39.224,26	29.501,49	3,02%	48.959,62	164,55	- 47.276,39
SUZB3	332.572,00	48.611,80	9.464,56	0,97%	12.560,73	47,54	- 15.914,64
UGPA3	330.176,00	46.757,50	4.836,09	-0,50%	50.518,18	181,68	- 56.850,49
VALE3	304.960,00	47.576,69	38.348,28	3,93%	113.878,17	374,50	- 104.785,59
DI1F22	52.072.372,80	66.509,25	56.298,55	5,77%	- 324.498,46	- 77.997,46	421.396,14
DI1N22	- 1.691.913,95	4.050,63	2.016,03	-0,21%	- 1.390,56	8.670,53	4.383,21
DI1F23	- 985.404,15	4.649,94	2.634,01	-0,27%	- 8.432,33	8.923,10	13.871,62
DI1F24	- 80.905,49	883,64	608,36	-0,06%	- 2.017,66	1.393,60	3.046,52
DI1F27	117.438,64	3.846,73	2.901,65	0,30%	9.179,64	- 4.986,19	- 12.690,99
COMPROMISSADA	185.273.565,58	164.947,37	131.216,44	13,44%	-1.669.409,67	- 10.219,41	2.291.794,68
DE252 AERIS CDI - AERI11	1.264.232,63	1.311,83	1.205,57	0,12%	- 9.476,58	- 1.037,41	12.820,05
ANHB10	1.032.388,43	911,68	787,60	0,08%	- 8.802,10	- 308,56	12.039,87
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.703.898,46	1.441,05	1.204,53	0,12%	- 14.844,98	- 352,74	20.319,38
DE252 BCBF CDI - BCBF14	267.836,48	256,33	232,52	0,02%	- 2.104,14	- 171,35	2.856,49
ELET13	2.113.556,62	2.370,83	2.195,54	0,22%	- 15.426,50	- 1.931,84	20.882,34
ETEN13	2.926.781,95	36.709,39	27.946,99	2,86%	78.135,77	- 50.681,50	- 106.841,89



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIM EMB II A CNPJ - 20725957000102

Dados Gerais

PL:	215.139.754,49	VAR / PL:	0,651%
VAR:	1.399.851,36	ETL / PL:	0,8160%
ETL:	1.755.470,68	VAR / CDI:	2747,01%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	3.321.052,18	BAIXA 1:	5.900.334,11	Cenário 1:	3.354.316,54
				Cenário 2:	-1.167.860,12
				Cenário 3:	-4.856.958,03

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	- 32.958,11	-	-	0,00%	-	-	-
WSPZ21	4.622.096,15	130.664,77	45.872,27	-3,28%	68.655,10	41.598,87	94.957,42
INDV21	8.640.294,00	426.723,48	93.959,75	6,71%	-	-	-
DI1F22	2.456.244,00	1.499,94	641,37	0,05%	6.918,48	3.592,09	10.649,98
DI1J22	1.250.520,39	1.782,31	1.235,99	0,09%	7.723,55	3.996,15	11.820,40
DI1N22	375.980,88	912,41	651,98	0,05%	3.711,03	1.913,46	5.646,88
DI1V22	550.321,19	1.914,66	1.376,00	0,10%	7.573,52	3.892,39	11.462,15
DI1F23	- 34.041.234,29	157.781,21	119.999,95	-8,57%	599.316,43	307.046,12	902.279,14
DI1N23	1.277.596,39	9.338,35	7.510,70	0,54%	32.746,27	16.669,97	48.778,71
DI1F24	2.346.259,07	25.104,15	21.108,23	1,51%	79.741,98	40.331,22	117.509,43
DI1N24	845.037,50	12.030,25	10.255,40	0,73%	35.840,66	18.011,70	52.258,53
DI1F25	1.164.592,96	20.838,11	17.735,20	1,27%	59.754,56	29.830,80	86.173,36
DI1F27	1.702.860,34	55.210,44	46.260,49	3,30%	148.512,88	72.239,37	205.183,16
DI1F29	2.502.996,41	117.423,00	96.940,85	6,93%	312.775,90	148.176,69	413.811,12
DI1F31	151.899,53	8.948,36	7.443,92	0,53%	24.916,41	11.497,80	31.581,19
AFSV21	- 1.239.307,24	67.658,66	18.304,60	1,31%	29.832,44	11.153,77	39.418,52
CANV21	- 1.237.635,22	37.393,28	6.732,55	-0,48%	11.056,30	11.144,98	15.184,21
CHLV21	1.253.797,73	52.048,60	10.063,66	-0,72%	18.454,57	11.265,84	25.521,28
EUPV21	- 1.448.254,64	28.051,77	2.161,42	0,15%	2.042,26	13.154,58	2.779,84
NZLV21	870.919,00	30.550,11	5.031,61	0,36%	20.139,49	7.904,09	28.134,31
SWIV21	1.245.322,03	34.393,02	12.023,24	0,86%	20.202,12	11.218,55	27.987,10
MEXX21	766.278,54	31.368,76	1.110,24	-0,08%	3.854,04	6.897,63	5.206,36
WDOX21	819.748,57	31.782,08	9.290,15	-0,66%	12.828,38	7.035,86	17.887,62
COMPROMISSADA	73.343.373,12	1.507,13	387,41	0,03%	2.776,87	1.446,48	4.298,04
AEGP13	1.057.035,10	65,73	37,88	0,00%	138,44	71,19	209,73
CPGT14	293.214,67	341,45	269,62	-0,02%	1.259,76	647,59	1.907,33
CPGT16	292.305,49	236,81	193,74	-0,01%	741,87	376,99	1.101,92
ERDV18	1.837.157,74	18.765,69	15.440,32	1,10%	50.227,60	24.034,60	67.553,48
ESUL18	988.732,74	234,08	161,47	-0,01%	960,01	498,92	1.480,19
LORTA1	539.560,69	55,30	15,32	0,00%	193,49	100,57	298,38
VIVT15	2.903.515,89	8.472,85	5.907,04	0,42%	25.643,72	13.548,48	40.554,52
LF selic	3.702.898,97	1.690,38	1.366,01	-0,10%	4.873,13	2.540,81	7.554,55
LFSN14000H2	2.293.405,99	142,98	32,11	0,00%	31,49	16,41	48,74
LFT	37.481.973,47	10.277,37	1.685,32	0,12%	0,29	-	0,39
NTNB	93.683.676,33	1.305.374,86	1.264.545,01	90,33%	3.015.615,69	-1.026.572,94	-5.716.647,25
IBOVJ118	- 3.060,00	7.680,53	1.649,44	-0,12%	140.923,12	106,39	3.060,00
IBOVJ124	- 360,80	1.240,51	266,41	-0,02%	124.136,70	17,33	360,80
IBOVV110	25.500,00	36.215,27	7.778,30	-0,56%	25.463,74	497,55	255.053,59
IBOVV113	99.050,00	121.310,78	26.055,37	-1,86%	98.920,77	1.672,43	583.299,83
IDIFQHM	-	0,00	0,00	0,00%	-12.287.197,24	-	-
IDIFQHN	-	0,00	0,00	0,00%	12.976.875,91	-	-
Total	213.390.354,55	2.797.029,47	1.399.851,36	100,00%	3.354.316,54	-1.167.860,12	-4.856.958,03



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIM EMB III A IMOBILIÁRIO CNPJ - 32711990000162

Dados Gerais

PL:	87.133.697,22	VAR / PL:	1,225%
VAR:	1.067.003,42	ETL / PL:	1,5356%
ETL:	1.338.065,79	VAR / CDI:	5169,85%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	8,42	BAIXA 1:	8,47	Cenário 1:	2.622.465,60
				Cenário 2:	7.473,11
				Cenário 3:	-3.338.581,13

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	25,85	5,08	0,00%	16,50	0,06	21,99
RECEBER	364.249,08	9.414,77	1.851,69	0,17%	6.009,27	23,24	8.009,98
AIEC11	215.541,00	7.934,42	908,19	0,09%	5.400,83	13,75	7.221,79
BLCPI1	1.526.877,30	39.465,30	7.762,02	0,73%	25.189,95	97,41	33.576,61
BMLC11	1.747.449,00	45.166,43	8.883,31	0,83%	28.828,87	111,48	38.427,07
BPML11	1.311.817,54	59.937,13	16.377,21	-1,53%	11.646,01	44,57	15.140,75
CBOP11	31.119,00	2.091,16	862,38	-0,08%	4.236,06	15,70	5.113,85
CEOC11	884.454,60	55.417,70	2.708,02	-0,25%	126.857,65	468,58	152.019,05
CJCT11	58.933,22	1.649,58	400,52	0,04%	972,26	3,76	1.295,96
CJCT12	2.269,00	58,65	11,53	0,00%	37,43	0,14	49,90
CNES11	578.981,70	21.831,95	6.531,19	0,61%	43.852,42	166,87	56.289,04
GALG11	1.001.675,00	30.496,62	2.399,50	0,22%	62.877,96	63,90	81.747,46
HBRH11	2.385.752,80	61.664,72	12.128,19	1,14%	39.359,41	152,20	52.463,61
HSML11	7.415.872,90	308.941,26	94.334,12	8,84%	207.647,45	803,78	277.442,95
JRDM11	1.113.014,90	60.243,89	59,91	-0,01%	18.237,97	74,07	27.262,94
LVBI11	3.975.276,04	157.302,93	77.850,41	7,30%	36.714,59	150,42	55.938,33
MALL11	7.506.464,54	204.734,01	16.599,24	-1,56%	32.327,37	119,93	38.901,71
MAXR11	1.493.528,80	125.592,50	8.602,37	0,81%	81.105,84	332,25	123.884,92
NEWU11	600.237,00	15.514,37	3.051,36	0,29%	9.902,52	38,29	13.199,44
PATC11	8.026.878,16	239.265,50	193.280,51	18,11%	415.053,23	1.595,07	545.233,26
PVBI11	3.039.733,44	275.798,64	109.932,03	-10,30%	504.095,79	193,92	590.679,45
QAGR11	8.343.591,40	177.929,99	132.567,40	12,42%	121.720,51	532,29	161.783,36
RBGS11	610.529,40	23.007,40	3.428,48	0,32%	33.009,15	126,74	43.269,30
RBRL11	2.001.448,94	61.714,96	28.491,26	2,67%	33.019,28	127,68	44.012,63
RCRB11	1.660.548,00	83.163,46	31.400,75	2,94%	22.069,12	85,14	29.250,99
RNGO11	157.674,14	9.158,03	4.719,34	0,44%	921,40	3,47	1.155,53
SDIL11	375.894,48	11.722,47	3.459,34	0,32%	663,38	3,03	1.267,59
TEPP11	7.991.482,00	625.252,96	455.870,64	42,72%	423.264,71	1.625,84	555.387,04
TRXF11	13.437.295,90	304.230,01	131.057,60	12,28%	225.272,28	871,23	300.365,37
VISC11	5.130,00	252,91	115,99	0,01%	444,38	1,68	564,19
VISC13	78,92	2,04	0,40	0,00%	1,30	0,01	1,74
VVPR11	1.302.160,00	33.657,02	6.619,65	0,62%	21.482,63	83,07	28.635,00
XPIN11	1.909.310,40	44.080,07	2.108,04	0,20%	126.855,60	121,81	164.338,03
XPIN13	294.229,80	7.604,98	1.495,74	0,14%	4.854,11	18,77	6.470,23
XPIN14	2.842.600,00	73.472,88	14.450,61	1,35%	46.896,33	181,35	62.509,86
XPPR11	3.530.350,80	185.948,01	29.982,16	-2,81%	143.430,40	225,22	190.187,45
COMPROMISSADA	322.559,00	8.334,88	1.634,59	0,15%	5.333,69	14,22	7.112,10
FII VIA PQ SHOPPING	1.594.252,91	41.206,76	8.104,53	0,76%	26.301,49	101,71	35.058,23
Total	89.660.261,11	3.413.286,19	1.067.003,42	100,00%	2.622.465,60	7.473,11	-3.338.581,13



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	525.273.439,50	VAR / PL:	4,336%
VAR:	22.777.213,34	ETL / PL:	5,4378%
ETL:	28.563.554,24	VAR / CDI:	18306,85%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	442,39	BAIXA 1:	445,01	Cenário 1:	70.168.366,26
				Cenário 2:	235.877,71
				Cenário 3:	-67.553.868,59

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	10.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	63.287,81	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	20.670.376,50	1.675.648,65	891.065,32	3,91%	2.983.316,51	10.867,36	- 3.460.249,20
ASAI3	7.987.280,00	786.373,99	382.059,54	-1,68%	-	-	-
AZUL4	5.366.834,00	417.806,13	15.589,43	0,07%	489.017,45	1.824,90	- 599.735,85
B3SA3	22.683.939,46	2.431.332,18	747.783,97	3,28%	2.939.756,04	10.779,51	- 3.461.828,28
UNT	15.428.112,00	1.469.521,80	1.334.403,44	5,86%	3.146.357,07	11.167,48	- 3.439.177,06
BBAS3	13.166.840,00	685.693,32	55.154,89	0,24%	908.767,79	3.426,50	- 1.141.619,20
BBDC4	29.905.443,53	2.285.994,55	1.687.861,04	7,41%	7.921.936,78	27.410,59	- 8.175.107,80
BIDI11	3.288.825,00	919.192,63	773.091,99	3,39%	1.256.448,73	4.151,27	- 1.170.028,38
BPAN4	3.064.320,00	380.892,32	327.117,93	1,44%	1.191.028,98	3.925,23	- 1.102.976,41
CCRO3	5.089.500,00	293.731,22	161.825,55	0,71%	624.045,50	2.295,47	- 740.225,19
CESP6	6.022.911,00	356.748,88	114.106,98	-0,50%	- 345.187,33	1.385,71	- 502.952,80
CIEL3	3.044.097,00	396.872,91	289.459,85	1,27%	1.918.479,68	5.805,61	- 1.477.223,63
CPFE3	5.781.871,00	834.601,23	298.107,05	-1,31%	- 822.580,08	- 3.458,29	- 1.340.709,99
CSED3	3.282.000,00	508.282,16	437.014,55	1,92%	-	-	-
ELET6	5.548.576,00	465.097,93	48.391,36	-0,21%	275.120,08	1.046,95	- 353.147,90
ENEV3	3.147.417,00	284.136,75	42.136,14	-0,18%	- 28.095,61	110,02	- 38.585,11
GNDI3	7.632.603,00	539.455,88	117.258,07	0,51%	188.983,61	727,84	- 249.512,39
HAPV3	17.222.607,00	1.360.646,78	252.655,82	1,11%	281.368,21	1.088,13	- 375.115,90
IFCM3	4.073.700,00	741.551,24	460.428,40	2,02%	-	-	-
INTB3	5.361.240,00	704.561,58	125.087,32	-0,55%	-	-	-
ITSA4	13.681.034,00	639.255,62	368.549,89	1,62%	819.111,59	3.101,84	- 1.039.433,86
ITUB4	37.199.264,41	3.155.411,87	1.700.825,30	7,47%	5.265.858,77	19.205,69	- 6.125.037,46
JBSS3	17.845.498,00	1.971.272,40	954.282,73	-4,15%	- 2.281.387,00	9.513,97	- 3.645.331,66
LAME4	4.730.348,00	2.780.954,62	890.129,04	-3,91%	1.207.160,84	4.193,56	- 1.256.949,76
LREN3	11.530.700,00	611.209,79	416.908,32	1,83%	2.535.996,00	8.940,23	- 2.729.676,23
LWSA3	5.548.400,00	624.930,76	499.484,15	2,19%	799.556,41	2.912,84	- 927.589,65
MGLU3	8.773.212,00	1.968.968,60	1.595.908,91	7,01%	3.931.885,85	12.674,80	- 3.468.994,44
MOVI3	8.093.925,00	1.287.464,60	847.492,89	3,72%	1.408.273,68	5.063,37	- 1.585.265,13
NTCO3	12.340.356,00	1.626.483,42	1.326.454,74	5,82%	2.937.507,61	10.277,38	- 3.108.048,11
PETR3	23.426.430,00	2.157.481,43	1.010.564,67	4,44%	1.683.470,13	6.339,02	- 2.108.235,19
PETR4	23.403.068,57	2.098.185,12	922.432,10	4,05%	1.874.092,64	7.029,69	- 2.326.001,78
PETZ3	3.460.350,00	581.019,37	326.146,57	1,43%	285.622,89	1.070,14	- 353.550,01
PRIO3	8.822.052,00	1.854.065,85	841.805,04	-3,70%	- 1.922.856,17	8.451,74	- 3.499.369,12
RADL3	6.478.164,00	400.620,40	132.156,87	0,58%	324.895,89	1.236,04	- 416.775,30
RAIL3	4.954.729,00	419.350,67	263.935,41	1,16%	748.905,04	2.719,80	- 862.612,01
RAPT4	5.178.488,00	775.387,44	12.670,07	0,06%	604.277,47	2.228,73	- 721.233,73
STBP3	8.267.025,00	1.131.474,29	346.354,40	1,52%	1.261.575,41	4.578,71	- 1.450.978,39
SUZB3	12.850.364,00	1.876.302,61	500.480,35	2,20%	601.613,36	2.292,44	- 774.640,51
TIMS3	5.079.525,00	361.189,33	10.213,02	-0,04%	- 166.436,15	659,70	- 235.242,98
TOTS3	11.002.666,30	1.370.479,42	875.835,32	3,85%	- 196.493,03	772,95	- 272.753,08
UGPA3	5.449.378,00	773.209,09	96.852,65	-0,43%	883.083,43	3.191,71	- 1.006.013,80
USIM5	8.559.720,00	1.729.226,77	992.940,93	4,36%	3.582.087,59	11.674,17	- 3.236.843,64
VALE3	61.083.106,80	9.478.951,45	7.447.553,50	32,70%	23.362.358,31	77.175,90	-21.747.586,37
WEGE3	13.795.203,00	1.388.489,86	566.193,73	-2,49%	- 2.311.199,68	9.858,39	- 3.903.592,85
COMPROMISSADA	16.955.411,76	348,42	173,32	0,00%	641,95	334,40	- 993,61
Total	526.223.623,52	58.599.875,31	22.777.213,34	100,00%	70.168.366,26	235.877,71	-67.553.868,59



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	55.159.524,30	VAR / PL:	4,439%
VAR:	2.448.280,44	ETL / PL:	5,5661%
ETL:	3.070.243,50	VAR / CDI:	18738,68%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	39,10	BAIXA 1:	39,34	Cenário 1:	5.863.274,41
				Cenário 2:	20.285,39
				Cenário 3:	- 6.023.244,33

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	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	292.222,44	-	-	0,00%	-	-	-
ALSO3	1.317.760,00	98.067,87	56.075,45	2,29%	351.367,89	1.214,90	- 362.017,56
AMER3	1.555.276,00	314.306,16	268.536,29	10,97%	-	-	-
ASAI3	323.394,40	31.839,24	6.606,96	-0,27%	-	-	-
B3SA3	1.885.214,24	202.062,88	117.765,82	4,81%	244.316,91	895,86	- 287.705,23
UNT	110.704,00	10.544,51	8.118,61	0,33%	22.576,60	80,13	- 24.677,72
BBDC4	664.477,00	50.793,12	18.201,80	0,74%	176.019,62	609,04	- 181.644,89
BBRK3	17.160,00	5.299,45	3.906,91	0,16%	3.720,68	13,13	- 4.016,78
BBSE3	367.080,00	33.214,94	8.252,71	-0,34%	31.211,56	116,80	- 38.530,49
BKBR3	70.606,00	9.815,99	8.642,49	0,35%	14.537,63	51,56	- 15.860,45
BMGB4	124.992,00	11.207,51	7.115,71	0,29%	32.491,89	112,65	- 33.683,46
BRAP4	1.163.791,55	185.046,64	89.115,51	3,64%	346.206,33	1.182,21	- 346.866,55
BRDT3	1.874.408,04	213.803,32	163.275,64	6,67%	325.057,89	1.169,02	- 366.119,63
BRML3	2.719.865,36	178.201,92	85.753,08	3,50%	729.562,82	2.520,91	- 750.576,41
CESP6	1.196.507,58	70.871,50	13.732,48	0,56%	- 68.574,69	- 275,28	99.916,28
CPFE3	1.726.213,00	249.175,31	4.718,99	-0,19%	- 245.586,32	- 1.032,49	400.277,18
CRFB3	1.316.655,36	67.891,75	21.365,54	0,87%	107.277,54	402,13	- 132.943,81
CYRE3	727.758,00	104.687,15	63.883,16	2,61%	60.722,42	227,41	- 75.090,52
ELET3	812.561,00	71.182,22	13.977,85	0,57%	57.941,26	218,23	- 72.604,88
ELET6	1.366.816,00	114.570,53	16.290,04	0,67%	67.772,08	257,90	- 86.993,17
EQTL3	2.322.060,00	143.464,06	15.588,03	0,64%	- 159.540,20	- 644,30	235.828,15
ESPA3	26.982,00	3.858,39	3.237,58	0,13%	-	-	-
EUCATEX PN	65.860,00	7.230,61	226,73	-0,01%	6.800,57	25,24	- 8.232,75
GGBR4	815.710,00	77.567,48	1.663,96	0,07%	204.409,11	711,45	- 213.752,00
GMAT3	180.007,26	12.991,86	514,87	0,02%	25.509,08	93,03	- 29.666,49
GNDI3	559.575,00	39.549,55	15.922,12	0,65%	13.855,10	53,36	- 18.292,70
HAPV3	323.170,20	25.531,59	8.629,88	0,35%	5.279,68	20,42	- 7.038,79
HBSA3	264.711,80	40.669,11	32.989,40	1,35%	91.961,34	307,90	- 88.189,40
HYPE3	1.569.074,80	123.583,81	39.266,08	1,60%	219.154,47	799,98	- 255.405,73
IGTA3	460.484,00	46.724,26	19.135,10	0,78%	154.393,65	519,39	- 149.618,91
ITSA4	1.360.194,00	63.555,99	9.470,40	0,39%	81.437,61	308,39	- 103.342,46
ITUB4	1.112.647,80	94.379,88	7.518,74	0,31%	157.504,36	574,45	- 183.202,80
LREN3	1.603.868,74	85.016,54	56.208,40	2,30%	352.745,69	1.243,55	- 379.685,74
MDNE3	78.870,00	9.925,94	8.302,17	0,34%	15.597,09	55,51	- 17.151,31
MULT3	680.512,80	49.324,60	26.139,83	1,07%	166.918,10	582,24	- 175.413,55
NTCO3	3.168.254,25	417.582,20	301.852,67	12,33%	754.173,62	2.638,61	- 797.958,07
OMGE3	991.175,76	101.063,88	41.558,27	1,70%	- 25.783,60	- 101,85	36.144,52
PARD3	533.021,00	109.182,29	29.453,61	1,20%	- 90.497,22	- 386,52	153.341,94
PETR3	2.154.544,70	198.425,03	213,37	0,01%	154.829,89	583,00	- 193.895,82



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	55.159.524,30	VAR / PL:	4,439%
VAR:	2.448.280,44	ETL / PL:	5,5661%
ETL:	3.070.243,50	VAR / CDI:	18738,68%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	39,10	BAIXA 1:	39,34	Cenário 1:	5.863.274,41
				Cenário 2:	20.285,39
				Cenário 3:	- 6.023.244,33

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
POWE3	75.400,00	-	-	0,00%	-	-	-
PRI03	695.906,28	146.253,51	25.498,74	-1,04%	151.679,87	666,69	276.039,29
QUAL3	173.913,00	36.991,61	16.026,35	0,65%	524,74	2,04	710,53
RAIL3	1.860.667,80	157.480,32	113.266,32	4,63%	281.239,09	1.021,38	323.939,89
RECV3	474.360,00	91.966,83	10.868,83	0,44%	-	-	-
RENT3	3.691.268,49	410.913,76	226.318,15	9,24%	106.727,39	410,21	140.241,08
SEER3	350.331,60	58.400,19	38.269,41	1,56%	157.675,87	507,93	138.902,12
SOMA3	1.146.040,35	185.771,44	86.696,51	3,54%	181.767,22	657,95	207.790,75
SULA11	2.266.777,24	205.552,77	147.069,22	6,01%	294.201,90	1.078,69	346.380,28
SUZB3	2.795.567,52	408.185,37	111.184,30	4,54%	130.879,62	498,71	168.521,29
SYNE3	178.017,00	6.910,43	3.500,10	0,14%	-	-	-
TEND3	1.368.297,00	144.589,73	125.999,52	5,15%	290.188,77	1.026,42	314.711,75
UGPA3	110.550,00	15.685,88	253,91	-0,01%	17.914,87	64,75	20.408,72
VALE3	348.950,48	54.150,56	27.715,52	1,13%	133.462,53	440,88	124.237,80
WEST3	117.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
YDUQ3	182.952,00	20.045,86	13.484,13	0,55%	34.945,10	124,72	38.681,58
COMPROMISSADA	1.498.754,47	30,80	19,30	0,00%	56,74	29,56	87,83
Total	55.239.939,31	5.615.138,16	2.448.280,44	100,00%	5.863.274,41	20.285,39	-6.023.244,33



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: 30/09/2021

FIA RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	33.810.172,33	VAR / PL:	4,407%
VAR:	1.489.933,83	ETL / PL:	5,5263%
ETL:	1.868.437,77	VAR / CDI:	18604,50%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	35,93	BAIXA 1:	36,08	Cenário 1:	4.356.021,33
				Cenário 2:	14.273,80
				Cenário 3:	- 4.058.376,36

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	5.000,01	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	20.145.967,40	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	970.020,00	78.634,89	45.353,58	3,04%	140.001,16	509,98	- 162.382,67
ALPA4	132.000,00	21.924,06	16.384,83	1,10%	16.586,39	60,93	- 19.612,09
AMER3	251.626,96	50.851,36	26.136,09	1,75%	-	-	-
ASAI3	230.384,00	22.682,06	12.910,24	-0,87%	-	-	-
AZUL4	182.050,00	14.172,53	667,87	-0,04%	16.588,11	61,90	- 20.343,82
B3SA3	1.156.792,00	123.988,41	26.668,00	1,79%	149.916,04	549,71	- 176.539,67
UNT	503.200,00	47.929,61	42.776,58	2,87%	102.620,91	364,24	- 112.171,46
BBAS3	612.680,00	31.906,71	363,52	0,02%	42.286,82	159,44	- 53.121,88
BBDC3	365.951,40	26.508,82	20.990,56	1,41%	91.368,07	318,13	- 95.625,87
BBDC4	1.453.725,70	111.123,88	87.948,62	5,90%	385.091,20	1.332,45	- 397.398,03
BBSE3	201.495,00	18.232,11	7.278,49	-0,49%	17.132,43	64,12	- 21.149,89
BEEF3	40.755,00	10.707,90	6.511,37	-0,44%	- 7.735,99	33,43	13.495,93
BIDI11	335.880,00	93.874,99	79.238,31	5,32%	128.318,17	423,96	- 119.492,26
BIDI4	45.472,00	12.064,49	10.155,87	0,68%	17.565,04	57,94	- 16.298,95
BPAN4	84.588,00	10.514,22	8.629,64	0,58%	32.877,36	108,35	- 30.446,74
BRAP4	207.564,17	33.003,38	21.432,55	1,44%	61.746,48	210,85	- 61.864,23
BRDT3	408.726,00	46.621,11	38.639,88	2,59%	70.880,84	254,91	- 79.834,60
BRFS3	330.498,00	46.570,02	22.788,60	-1,53%	- 12.750,95	50,69	18.151,26
BRKM5	237.360,00	47.043,69	16.680,35	1,12%	- 28.350,85	117,68	44.787,46
BRML3	104.232,00	6.829,14	4.392,89	0,29%	27.958,66	96,61	- 28.763,95
CASH3	50.484,00	27.822,58	13.447,47	0,90%	35.700,71	-	- 26.077,05
CCRO3	196.560,00	11.344,10	5.824,56	0,39%	24.101,07	88,65	- 28.588,01
CIEL3	39.388,00	5.135,19	3.684,61	0,25%	24.823,48	75,12	- 19.114,00
CMIG4	234.146,67	40.873,94	23.498,92	-1,58%	- 52.442,04	231,35	96.323,79
COGN3	74.796,00	8.176,33	4.715,73	0,32%	23.439,24	79,53	- 23.154,39
CPFE3	75.404,00	10.884,41	3.787,30	-0,25%	- 10.727,64	45,10	17.484,81
CPL6	169.624,00	13.765,08	7.995,25	-0,54%	- 23.657,10	99,30	38.409,00
CRFB3	110.112,00	5.677,79	704,07	-0,05%	8.971,63	33,63	- 11.118,10
CSAN3	399.852,00	54.687,17	3.256,96	0,22%	9.270,28	35,73	- 12.261,62
CSNA3	275.808,00	66.045,01	51.793,14	3,48%	199.636,00	586,16	- 144.213,59
CVCB3	73.168,00	17.442,90	4.664,52	-0,31%	- 7.910,27	32,63	12.307,93
CYRE3	75.600,00	10.874,97	1.315,81	0,09%	6.307,89	23,62	- 7.800,45
DXCO3	69.577,00	11.253,21	8.885,69	0,60%	-	-	-
ECOR3	48.492,00	5.407,26	413,71	-0,03%	4.133,01	15,47	- 5.101,05
EGIE3	146.094,00	9.838,70	2.677,72	-0,18%	- 8.377,31	33,63	12.206,55
ELET3	207.954,00	18.217,25	2.348,88	-0,16%	14.828,57	55,85	- 18.581,34
ELET6	143.264,00	12.008,81	2.448,01	-0,16%	7.103,59	27,03	- 9.118,26
ENBR3	66.096,00	4.290,54	1.258,44	-0,08%	- 3.040,94	12,14	4.368,72



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIA RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	33.810.172,33	VAR / PL:	4,407%
VAR:	1.489.933,83	ETL / PL:	5,5263%
ETL:	1.868.437,77	VAR / CDI:	18604,50%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	35,93	BAIXA 1:	36,08	Cenário 1:	4.356.021,33
				Cenário 2:	14.273,80
				Cenário 3:	-4.058.376,36

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
ENEV3	309.636,00	27.952,75	- 7.036,46	-0,47%	- 2.763,98	- 10,82	3.795,92
ENGI11	162.467,00	11.604,33	- 1.860,87	-0,12%	- 2.734,66	- 10,75	3.791,32
EQTL3	382.785,00	23.649,64	- 6.737,11	-0,45%	- 26.299,75	- 106,21	38.875,60
EZTC3	34.260,00	4.210,41	1.343,03	0,09%	4.917,11	17,92	5.707,88
FLRY3	101.752,00	8.095,04	- 814,64	-0,05%	1.457,20	5,64	- 1.947,27
GGBR4	444.440,00	42.262,68	21.899,47	1,47%	111.372,40	387,63	- 116.462,89
GNDI3	664.029,00	46.932,13	11.085,63	0,74%	16.441,39	63,32	- 21.707,33
GOAU4	130.410,00	12.250,40	6.579,56	0,44%	31.242,41	109,24	- 33.008,73
GOLL4	55.419,96	10.988,63	- 5.903,05	-0,40%	- 3.749,23	- 15,13	5.534,58
HAPV3	269.082,00	21.258,43	4.325,40	0,29%	4.396,03	17,00	- 5.860,72
HYPE3	196.054,00	15.441,65	10.578,59	0,71%	27.383,09	99,96	- 31.912,64
IGTA3	44.156,00	4.480,41	2.469,79	0,17%	14.804,87	49,80	- 14.347,02
IRBR3	90.343,00	6.615,58	3.332,75	0,22%	14.641,46	52,92	- 16.679,41
ITSA4	757.520,00	35.395,64	21.195,18	1,42%	45.354,28	171,75	- 57.553,54
ITUB4	2.016.421,00	171.042,06	101.298,95	6,80%	285.440,81	1.041,06	- 332.013,40
JBSS3	759.935,00	83.944,92	- 43.362,21	-2,91%	- 97.150,88	- 405,14	155.233,28
JHSF3	27.824,00	3.247,92	2.105,08	0,14%	8.251,32	28,19	- 8.273,92
KLBN11	292.941,00	32.327,03	18.969,66	1,27%	26.607,80	99,31	- 32.642,19
LAME4	61.214,00	35.987,49	- 14.073,71	-0,94%	15.621,50	54,27	- 16.265,81
LCAM3	119.021,00	11.653,29	2.761,51	0,19%	3.847,87	14,77	- 5.036,45
LREN3	457.786,00	24.265,94	14.804,96	0,99%	100.682,83	354,94	- 108.372,22
LWSA3	148.720,00	16.750,72	12.854,46	0,86%	21.431,41	78,08	- 24.863,23
MGLU3	602.280,00	135.169,47	115.631,35	7,76%	269.923,51	870,12	- 238.146,07
MRFG3	138.564,00	23.598,75	- 16.494,66	-1,11%	- 40.177,83	- 184,86	82.104,78
MRVE3	88.488,00	14.314,52	- 3.099,47	-0,21%	661,31	2,57	- 890,79
MULT3	78.023,00	5.655,23	3.213,08	0,22%	19.137,70	66,76	- 20.111,73
NTCO3	574.182,00	75.678,33	64.641,97	4,34%	136.678,71	478,19	- 144.613,76
PACUCAR_CBD ON ED	61.776,00	4.628,49	1.834,94	0,12%	15.749,05	54,72	- 16.402,52
PETR3	1.435.650,00	132.217,68	65.246,96	4,38%	103.168,68	388,48	- 129.199,71
PETR4	1.851.640,00	166.007,44	76.033,73	5,10%	148.277,35	556,19	- 184.032,19
PETZ3	91.494,00	15.362,55	9.043,40	0,61%	7.552,06	28,30	- 9.348,10
PRI03	312.750,00	65.728,37	- 34.832,52	-2,34%	- 68.167,05	- 299,62	124.055,91
QUAL3	85.957,00	18.283,21	- 2.162,51	-0,15%	259,35	1,01	- 351,18
RADL3	373.920,00	23.123,83	7.890,02	0,53%	18.753,01	71,34	- 24.056,29
RAIL3	305.578,00	25.863,04	16.586,12	1,11%	46.187,98	167,74	- 53.200,74
RDOR3	325.968,00	33.538,76	14.483,14	0,97%	32.887,36	-	-
RENT3	484.783,00	53.966,27	4.538,86	0,30%	14.016,76	53,87	- 18.418,19
SANB11	208.683,00	26.468,25	18.595,17	1,25%	54.797,93	189,79	- 56.669,53
SBSP3	196.707,00	21.184,05	- 11.869,04	-0,80%	- 10.482,33	- 41,99	15.196,42
SOMA3	107.412,15	17.411,35	13.710,29	0,92%	17.036,06	61,67	- 19.475,10
SULA11	112.112,00	10.166,39	4.636,38	0,31%	14.550,86	53,35	- 17.131,54



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIA RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	33.810.172,33	VAR / PL:	4,407%
VAR:	1.489.933,83	ETL / PL:	5,5263%
ETL:	1.868.437,77	VAR / CDI:	18604,50%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	35,93	BAIXA 1:	36,08	Cenário 1:	4.356.021,33
				Cenário 2:	14.273,80
				Cenário 3:	-4.058.376,36

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
SUZB3	594.268,00	86.770,04	28.920,91	1,94%	27.821,75	106,01	- 35.823,43
TAE11	118.272,00	9.139,75	4.570,61	0,31%	16.803,78	61,27	- 19.535,09
TIMS3	142.175,00	10.109,63	312,93	-0,02%	- 4.658,52	18,46	6.584,41
TOTS3	259.920,00	32.375,34	20.440,87	1,37%	- 4.641,83	18,26	6.443,35
UGPA3	238.788,00	33.881,49	6.861,87	-0,46%	38.696,11	139,86	- 44.082,83
USIM5	201.500,00	40.706,84	23.112,70	1,55%	84.324,10	274,82	- 76.196,88
VALE3	3.712.888,00	576.170,51	478.306,24	32,10%	1.420.062,34	4.691,08	-1.321.909,72
VIIA3	185.040,00	53.066,55	40.545,40	2,72%	-	-	-
VIVT3	287.229,00	16.424,40	2.330,78	-0,16%	5.108,44	19,74	- 6.799,08
WEGE3	879.786,00	88.550,63	43.963,35	-2,95%	- 147.396,24	628,72	248.950,77
YDUQ3	175.824,00	19.264,86	5.284,49	0,35%	33.583,61	119,86	- 37.174,50
COMPROMISSADA	1.589.535,43	32,66	18,13	0,00%	60,18	31,35	- 93,15
EMP AÇÃO PROVISÃO	- 29.650,63	2,58	1,63	0,00%	8,18	4,26	12,66
Total	53.780.145,22	3.674.146,95	1.489.933,83	100,00%	4.356.021,33	14.273,80	-4.058.376,36



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	56.887.530,04	VAR / PL:	4,682%
VAR:	2.663.721,13	ETL / PL:	5,8720%
ETL:	3.340.414,91	VAR / CDI:	19768,34%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	836,35	BAIXA 1:	1.029,09	Cenário 1:	7.611.188,05
				Cenário 2:	24.975,73
				Cenário 3:	-7.104.417,04

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	- 526.439,05	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	1.771.877,70	143.637,66	83.951,47	3,15%	255.731,77	931,56	- 296.614,74
ALPA4	221.443,20	36.779,81	27.633,12	1,04%	27.825,33	102,21	- 32.901,24
AMER3	445.928,24	90.117,76	45.979,31	1,73%	-	-	-
ASAI3	372.555,68	36.679,33	21.302,83	-0,80%	-	-	-
AZUL4	307.191,17	23.914,72	1.350,09	-0,05%	27.990,78	104,46	- 34.328,16
B3SA3	2.020.372,90	216.549,58	43.672,88	1,64%	261.832,98	960,09	- 308.331,98
UNT	843.338,04	80.327,63	71.361,35	2,68%	171.987,51	610,44	- 187.993,76
BBAS3	1.091.321,80	56.833,08	58,80	0,00%	75.322,41	284,00	- 94.622,09
BBDC3	653.693,86	47.352,33	37.850,22	1,42%	163.209,50	568,27	- 170.815,16
BBDC4	2.580.128,78	197.226,98	157.553,06	5,91%	683.474,80	2.364,88	- 705.317,44
BBSE3	352.815,75	31.924,25	13.074,66	-0,49%	29.998,72	112,27	- 37.033,25
BEEF3	67.036,75	17.613,12	10.916,59	-0,41%	- 12.724,71	54,99	22.199,07
BIDI1	570.996,00	159.587,49	134.444,01	5,05%	218.140,89	720,73	- 203.136,84
BIDI4	74.229,12	19.694,24	16.523,01	0,62%	28.673,41	94,58	- 26.606,63
BPAN4	138.963,72	17.273,07	14.082,66	0,53%	54.011,92	178,01	- 50.018,83
BRAP4	338.239,17	53.781,13	34.721,72	1,30%	100.619,86	343,59	- 100.811,74
BRDT3	726.921,54	82.915,91	68.451,90	2,57%	126.061,98	453,36	- 141.986,29
BRFS3	568.023,12	80.039,36	39.822,01	-1,49%	- 21.914,90	87,12	31.196,37
BRKM5	405.054,84	80.280,05	28.515,60	1,07%	- 48.380,72	200,82	76.429,80
BRML3	176.459,12	11.561,36	7.380,41	0,28%	47.332,49	163,55	- 48.695,81
CASH3	89.867,53	49.527,51	23.577,60	0,89%	63.551,52	-	- 46.420,25
CCRO3	340.294,50	19.639,48	9.908,65	0,37%	41.724,97	153,48	- 49.492,99
CIEL3	70.912,14	9.245,14	6.616,61	0,25%	44.690,92	135,24	- 34.411,88
CMIG4	404.695,35	70.645,86	40.877,52	-1,53%	- 90.639,98	399,87	166.484,49
COGN3	131.627,41	14.388,86	8.201,30	0,31%	41.248,82	139,96	- 40.747,53
CPFE3	127.486,62	18.402,43	6.353,57	-0,24%	- 18.137,37	76,25	29.561,81
CPLE6	294.658,00	23.911,65	13.916,92	-0,52%	- 41.095,32	172,50	66.721,21
CRFB3	186.995,04	9.642,17	1.265,51	-0,05%	15.235,85	57,11	- 18.881,05
CSAN3	689.308,08	94.275,65	4.403,88	0,17%	15.981,10	61,60	- 21.137,90
CSNA3	481.917,02	115.399,89	90.858,52	3,41%	348.822,32	1.024,19	- 251.983,20
CVCB3	128.366,80	30.602,04	8.509,95	-0,32%	- 13.877,87	57,25	21.593,17
CYRE3	135.288,00	19.461,02	2.185,83	0,08%	11.288,11	42,28	- 13.959,10
DXCO3	115.837,22	18.735,22	14.952,52	0,56%	-	-	-
ECOR3	80.622,44	8.990,07	784,03	-0,03%	6.871,52	25,71	- 8.480,97
EGIE3	240.305,90	16.183,40	4.410,79	-0,17%	- 13.779,60	55,32	20.078,21
ELET3	368.078,58	32.244,54	4.613,93	-0,17%	26.246,57	98,86	- 32.888,98
ELET6	248.776,00	20.853,13	4.541,49	-0,17%	12.335,29	46,94	- 15.833,74
ENBR3	109.884,60	7.133,03	2.087,33	-0,08%	- 5.055,56	20,18	7.263,00



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	56.887.530,04	VAR / PL:	4,682%
VAR:	2.663.721,13	ETL / PL:	5,8720%
ETL:	3.340.414,91	VAR / CDI:	19768,34%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	836,35	BAIXA 1:	1.029,09	Cenário 1:	7.611.188,05
				Cenário 2:	24.975,73
				Cenário 3:	-7.104.417,04

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	
ENEV3	538.536,06	48.616,97	-	12.936,58	-0,49%	- 4.807,27	- 18,83	6.602,07
ENGI11	282.121,75	20.150,76	-	3.163,03	-0,12%	- 4.748,70	- 18,67	6.583,58
EQTL3	660.925,20	40.834,01	-	11.769,25	-0,44%	- 45.409,74	- 183,39	67.123,49
EZTC3	61.485,28	7.556,27	-	2.381,43	0,09%	8.824,57	32,16	- 10.243,75
FLRY3	173.796,84	13.826,68	-	1.391,98	-0,05%	2.488,96	9,64	- 3.326,01
GGBR4	779.802,50	74.152,97	-	38.564,25	1,45%	195.411,03	680,13	- 204.342,66
GNDI3	1.143.995,13	80.855,10	-	19.436,11	0,73%	28.325,37	109,09	- 37.397,59
GOAU4	226.491,12	21.276,02	-	11.430,47	0,43%	54.260,63	189,72	- 57.328,30
GOLL4	86.650,64	17.181,03	-	9.415,53	-0,35%	- 5.862,02	- 23,66	8.653,47
HAPV3	456.338,61	36.052,36	-	7.510,74	0,28%	7.455,27	28,83	- 9.939,25
HYPE3	347.722,66	27.387,41	-	18.895,58	0,71%	48.566,82	177,28	- 56.600,46
IGTA3	68.504,88	6.951,03	-	3.789,24	0,14%	22.968,70	77,27	- 22.258,38
IRBR3	154.472,34	11.311,60	-	5.635,42	0,21%	25.034,59	90,48	- 28.519,18
ITSA4	1.323.554,54	61.843,99	-	37.372,11	1,40%	79.243,93	300,08	- 100.558,73
ITUB4	3.650.618,84	309.662,20	-	186.289,98	6,99%	516.774,82	1.884,79	- 601.091,92
JBSS3	1.314.502,20	145.204,24	-	75.923,86	-2,85%	- 168.047,33	- 700,80	268.515,71
JHSF3	47.993,44	5.602,32	-	3.600,53	0,14%	14.232,65	48,62	- 14.271,63
KLBN11	515.382,48	56.874,20	-	33.778,58	1,27%	46.812,13	174,72	- 57.428,68
LAME4	111.293,80	65.429,23	-	25.979,92	-0,98%	28.401,61	98,66	- 29.573,03
LCAM3	204.448,93	20.017,49	-	4.557,88	0,17%	6.609,69	25,36	- 8.651,39
LREN3	796.478,80	42.219,09	-	25.349,63	0,95%	175.172,98	617,54	- 188.551,37
LWSA3	255.340,80	28.759,70	-	21.899,57	0,82%	36.796,08	134,05	- 42.688,25
MGLU3	1.067.383,56	239.552,48	-	205.694,89	7,72%	478.368,73	1.542,07	- 422.051,54
MRFG3	231.145,28	39.366,20	-	27.795,49	-1,04%	- 67.022,57	- 308,38	136.962,93
MRVE3	95.948,03	15.521,31	-	3.513,75	-0,13%	717,06	2,79	- 965,89
MULT3	137.510,78	9.966,99	-	5.599,63	0,21%	33.729,03	117,65	- 35.445,70
NTCO3	1.020.722,43	134.533,24	-	115.308,29	4,33%	242.973,53	850,09	- 257.079,65
PACUCAR_CBD ON ED	106.151,76	7.953,28	-	3.122,35	0,12%	27.062,12	94,02	- 28.185,00
PETR3	2.496.792,40	229.944,69	-	115.088,03	4,32%	179.424,50	675,61	- 224.696,02
PETR4	3.218.068,63	288.513,61	-	134.074,04	5,03%	257.699,49	966,63	- 319.839,83
PETZ3	153.334,56	25.746,05	-	15.346,27	0,58%	12.656,48	47,42	- 15.666,46
PRIO3	531.124,56	111.622,55	-	60.278,76	-2,26%	- 115.764,01	- 508,83	210.676,71
QUAL3	145.047,44	30.851,85	-	3.964,12	-0,15%	437,64	1,70	- 592,60
RADL3	659.127,48	40.761,54	-	13.924,43	0,52%	33.056,87	125,76	- 42.405,23
RAIL3	529.002,53	44.772,90	-	28.505,47	1,07%	79.958,49	290,39	- 92.098,67
RDOR3	549.867,27	56.575,69	-	24.947,66	0,94%	55.476,86	-	-
RENT3	837.367,31	93.216,13	-	6.891,82	0,26%	24.211,20	93,06	- 31.813,81
SANB11	343.371,96	43.551,49	-	31.039,23	1,17%	90.165,82	312,28	- 93.245,38
SBSP3	335.057,59	36.083,49	-	20.548,33	-0,77%	- 17.854,90	- 71,53	25.884,57
SOMA3	85.139,85	13.801,04	-	10.877,88	0,41%	13.503,57	48,88	- 15.436,87
SULA11	192.017,28	17.412,25	-	7.959,51	0,30%	24.921,66	91,37	- 29.341,66



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	56.887.530,04	VAR / PL:	4,682%
VAR:	2.663.721,13	ETL / PL:	5,8720%
ETL:	3.340.414,91	VAR / CDI:	19768,34%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	836,35	BAIXA 1:	1.029,09	Cenário 1:	7.611.188,05
				Cenário 2:	24.975,73
				Cenário 3:	-7.104.417,04

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
SUZB3	1.017.670,32	148.591,70	50.905,60	1,91%	47.644,10	181,55	61.346,80
TAEE11	203.392,00	15.717,60	7.991,03	0,30%	28.897,40	105,37	33.594,43
TIMS3	249.664,00	17.752,84	516,29	-0,02%	8.180,51	32,43	11.562,44
TOTS3	484.462,00	60.344,03	38.055,00	1,43%	8.651,85	34,03	12.009,68
UGPA3	411.304,96	58.359,82	12.478,49	-0,47%	66.652,85	240,90	75.931,32
USIM5	220.715,04	44.588,65	25.230,66	0,95%	92.365,24	301,02	83.463,02
VALE3	6.653.541,04	1.032.504,66	860.772,49	32,31%	2.544.769,22	8.406,47	-2.368.878,50
VIIA3	333.280,17	95.579,49	73.865,62	2,77%	-	-	-
VIVT3	490.432,80	28.044,05	3.770,54	-0,14%	8.722,47	33,71	11.609,18
WEGE3	1.520.325,69	153.021,08	77.769,34	-2,92%	254.710,01	1.086,46	430.202,62
YDUQ3	192.622,32	21.105,43	5.599,63	0,21%	36.792,20	131,31	40.726,18
INDV21	553.865,00	27.354,07	27.306,18	1,03%	-	-	-
WINV21	553.865,00	27.930,84	27.266,48	1,02%	-	-	-
COMPROMISSADA	1.428.486,04	29,35	16,38	0,00%	54,08	28,17	83,71
EMP AÇÃO PROVISÃO	1.073,86	0,29	0,22	0,00%	1,20	0,62	1,85
LFT	297.738,30	51,08	1,14	0,00%	0,00	0,00	0,00
Total	58.001.148,76	6.415.856,40	2.663.721,13	100,00%	7.611.188,05	24.975,73	-7.104.417,04



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/09/2021

FIM EMB V A INVEST NO EXT CNPJ - 41252756000105

Dados Gerais

PL:	75.949.406,91	VAR / PL:	19,102%
VAR:	14.507.569,22	ETL / PL:	23,9542%
ETL:	18.193.083,33	VAR / CDI:	80643,38%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	7.622.959,60	BAIXA 1:	-	7.542.729,06	Cenário 1:	-	938.026,75
					Cenário 2:	-	568.362,10
					Cenário 3:	-	1.297.392,18

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	45.434,42	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	- 4.694,54	-	-	0,00%	-	-	-
EWJ_US	3.235.527,01	125.369,85	- 51.948,88	-0,36%	- 48.059,45	- 29.119,74	66.471,42
SPY	7.730.538,11	290.322,58	- 117.090,93	-0,81%	-114.826,87	- 69.574,84	158.817,98
VTV_US	6.743.847,26	261.309,87	- 108.277,67	-0,75%	-100.170,89	- 60.694,63	138.547,17
COMPROMISSADA	36.334,35	0,75	0,24	0,00%	1,38	- 0,72	- 2,13
LFT	10.903,53	10,22	4,53	0,00%	0,00	0,00	- 0,00
AB AMERICAN GROWTH	8.769.950,19	566.912,06	218.809,88	1,51%	-130.265,96	- 78.929,55	180.171,90
FUNDSMITH EQ FUND	10.289.138,98	545.025,79	140.664,01	0,97%	-152.831,49	- 92.602,25	211.382,47
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.303.183,56	225.278,76	100.061,31	0,69%	-	-	-
JANUS H GL FICFIA IE	3.820.655,62	126.305,51	43.813,87	0,30%	-	-	-
LOOMIS US GROWTH	7.468.111,42	12.459.601,75	12.316.385,77	84,90%	-110.928,87	- 67.213,00	153.426,62
EUROPEA	5.627.096,60	284.134,55	54.227,00	0,37%	- 83.583,04	- 50.643,87	115.604,38
PICTET GL FIC FIM IE	3.806.045,34	103.273,35	30.539,32	0,21%	-	-	-
RESEAR	3.204.823,77	122.994,11	- 46.605,15	-0,32%	- 47.603,40	- 28.843,41	65.840,65
QUAL	10.082.231,66	1.931.597,82	1.926.985,94	13,28%	-149.758,15	- 90.740,08	207.131,72
Total	75.169.127,27	17.042.136,98	14.507.569,22	100,00%	-938.026,75	- 568.362,10	1.297.392,18



3. RISCO DE CRÉDITO

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

3.1. Relatório de Risco de Crédito



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/09/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Data Aquisição	Data Vencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB II	20/10/14	15/01/23	SABESP	1.117.927,35	BRSPSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	21/10/14	15/01/23	SABESP	5.584.874,89	BRSPSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	24/02/15	15/01/23	SABESP	2.873.626,61	BRSPSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	04/03/15	02/03/22	B VOTORA	23.790.860,87	BRZXSZLFN364	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.080.914,49	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.080.073,25	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.188.302,43	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/06/15	15/04/23	RD COLIN	1.393.503,22	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	09/06/15	07/06/22	B VOTORA	11.047.349,32	BRZXSZLFN6P8	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB II	30/06/15	28/06/22	B VOTORA	11.105.421,34	BRZXSZLFN7G5	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	12/08/15	16/07/23	DUKE GEP	2.616.768,76	BRGEPADBS079	-	Aaa.br	-
FI RF EMB II	06/11/15	04/11/22	BRADESCO	6.716.458,83	BRBBDCLFR744	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	18/11/15	16/11/22	BRADESCO	16.717.957,02	BRBBDCLFR8X2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/04/22	ECPT	16.242,35	BRASCPDBS011	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/07/22	ECPT	15.824,19	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/10/22	ECPT	49.878,67	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/01/23	ECPT	48.586,58	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	11/02/16	15/01/23	ECPT	169.171,69	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/07/22	ECPT	138.324,71	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/10/22	ECPT	435.039,77	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/04/22	ECPT	65.148,33	BRASCPDBS011	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/04/22	ECPT	76.585,06	BRASCPDBS011	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/01/23	ECPT	813.733,60	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/24	TRANS AL	2.261.424,53	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	835.011,30	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	501.006,78	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/24	TRANS AL	1.667.989,50	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	28/07/16	04/10/21	B VOTORA	2.293.174,48	BRZXSZLFIZH0	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	426.682,28	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	274.438,41	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/09/16	15/10/22	ECPT	1.159.349,31	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	10/10/16	15/01/23	SABESP	221.018,34	BRSPSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FIM EMB II A	12/12/16	12/01/22	LOCALIZA	538.609,82	BRRENTDBS0C4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	12/12/16	12/01/22	LOCALIZA	609.746,97	BRRENTDBS0C4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.117.157,26	BRVIVTDBS069	brAAA	-	-
FIM EMB II A	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.509.671,98	BRVIVTDBS069	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/04/22	ECPT	275.943,91	BRASCPDBS011	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/07/22	ECPT	271.191,00	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/10/22	ECPT	841.759,47	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/01/23	ECPT	397.111,14	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/01/23	ECPT	747.868,87	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/07/22	ECPT	17.363,25	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/17	15/04/23	RD COLIN	2.570.136,26	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	25/08/17	15/08/24	PETR	15.975.230,32	BRPETRDBS084	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FIM EMB II A	22/09/17	15/09/22	ENERSUL	266.552,90	BRENERDBS024	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/11/27	RB CAPIT	4.051.782,73	BRBRACRI4G2	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/11/27	RB CAPIT	1.182.501,71	BRBRACRI4G2	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/11/27	RB CAPIT	4.223.706,91	BRBRACRI4G2	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	29/01/18	27/10/22	SUL AME	1.317.707,01	BRULADBS0A0	-	-	A+(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	15/02/25	SABESP	8.530.427,15	BRSPSPDBS1A7	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.294.061,91	BRSPSPDBS1A7	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	11.682.304,69	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB II	23/05/18	15/05/28	COMGAS	25.589.016,89	BRGASDBS093	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	574.571,02	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	574.571,02	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	574.571,02	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	573.123,98	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	574.571,02	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	10.833.526,58	BRERDDBS0E8	-	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	15/07/25	AEGEASA	12.488.273,38	BRAEGPDBS038	brA	Aa1.br	-
FI RF EMB II	26/07/18	15/07/25	CSMG	14.004.736,51	BRCSMGDBS0E7	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/22	CEMG G	1.529.726,59	BRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/22	CEMG G	73.999,46	BRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/22	CEMG G	519.209,34	BRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	802.750,21	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	455.614,98	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	1.204.125,31	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/25	CEMG	2.339.709,53	BRCMGDBS041	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB II A	14/11/18	15/03/24	BRADESCO	293.838,63	BRBBDCLTR6K7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	04/01/19	07/06/24	MOV_PART	1.174.117,21	BRMOVDBS085	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB II A	17/01/19	16/09/24	ITAUUBB	281.333,66	BRBITALFIU67	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	2.454.947,49	BRBITALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	2.454.947,49	BRBITALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	19/08/20	14/08/24	B3SA	1.676.766,64	BRB3SADBS032	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	505.503,72	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	3.200.713,49	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	1.822.729,77	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	5.510.719,69	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/09/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	622.739,22	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	5.038.526,50	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	7.472.870,76	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	769.932,14	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	552.894,69	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	22/09/25	BCBF	256.721,97	BRBCFDBS032	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	08/01/21	15/04/24	ECORODOV	1.351.535,07	BRERDVDBS0F5	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	20/01/21	15/07/23	AEGEA SA	575.230,46	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	20/01/21	23/07/23	COPEL GT	176.033,14	BRCPGTDBS032	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	04/02/21	15/07/23	AEGEA SA	194.444,10	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	05/02/21	23/07/23	COPEL GT	110.633,31	BRCPGTDBS032	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/23	AEGEA SA	267.360,64	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/24	COPEL GT	284.238,08	BRCPGTDBS057	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	22/08/22	ITAU	4.841.332,21	BRBITALFIBU7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	5.716.313,97	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	5.731.079,80	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.703.761,26	BRELETDDBS032	brAAA	Ba2	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	516.895,51	BRNEOEDBS047	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	5.138.199,34	BRNEOEDBS047	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	1.533.711,50	BRELETDDBS032	brAAA	Ba2	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	2.939.573,90	BRELETDDBS032	brAAA	Ba2	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.145.050,54	BRELETDDBS032	brAAA	Ba2	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	15/07/34	IGUA SAN	2.400.491,20	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/28	COMGAS	22.287.208,26	BRCGASDBS093	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	9.088.220,14	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	763.850,75	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	763.850,75	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	6.110.805,97	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	3.819.253,73	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	5.346.955,22	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	607.770,01	BRMGTDDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	151.942,50	BRMGTDDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	1.084.869,48	BRMGTDDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	16/07/23	DUKE GEP	10.608.896,43	BRGEPADBS079	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	853.235,25	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	154.373,58	BRMGTDDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.501.694,04	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	1.106.141,43	BRMGTDDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.706.470,50	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	853.235,25	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECPT	514.568,96	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/22	ECPT	130.219,43	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.044.359,94	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/11/22	ITAU	7.648.618,73	BRBITALFIDR9	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	3.492.209,44	BRERDVDBS052	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	1.164.676,11	BRERDVDBS052	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/22	SUL AME	1.549.491,95	BRSLADBS053	-	-	A+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	1.456.138,29	BRERDVDBS052	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	876.397,46	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	2.542.739,25	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	27/01/25	BRADESCO	10.851.827,47	BRBBDCLFRZJ5	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	CCR	5.560.927,89	BRCCRODBS0G5	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	ECORODOV	3.814.103,07	BRERDVDBS0D0	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/25	SABESP	1.243.321,26	BRBSPPDBS1A7	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/28	COMGAS	9.905.425,89	BRCGASDBS093	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	JAGUARA	1.794.924,38	BRJNGDBS018	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	ENERGMR	1.081.473,69	BRENMDBS018	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	01/08/25	BRADESCO	3.537.817,11	BRBBDCLTR2J8	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/24	SONAE	367.869,69	BRSSBRDBS037	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/24	SONAE	429.181,30	BRSSBRDBS037	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/24	SONAE	429.181,30	BRSSBRDBS037	-	-	AA+(bra)
FIM EMB I A	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	975.423,75	BRBRVLFIS2	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	582.539,84	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	143.591,99	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	441.282,69	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	3.270.318,85	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	648.499,09	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	594.992,57	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	1.360.037,91	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	1.615.701,69	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	3.384.334,69	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	664.258,86	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	609.390,38	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.326.961,84	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/09/34	BRKA	4.455.400,26	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	3.826.840,98	BRAMERDDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/38	TAUBATE	8.643.617,26	BRLTTEDBS048	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/26	IRB	5.853.559,36	BRIRBRDDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	981.555,88	BRAMERDDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.513.672,66	BRMGPRDDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/29	ANET	2.841.305,16	BRANETDDBS002	brA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/29	CAGECE	2.409.417,68	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/28	BRISANET	3.199.644,41	BRBRSTDBS001	brA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/36	PAMPASUL	1.028.988,70	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/09/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/27	GETI	1.959.608,27	BRTIETDBS0B1	-	Aa1.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	846.494,33	BRLIGHDBS0D7	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	1.894.534,92	BRLIGHDBS0D7	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	1.193.153,91	BRLIGHDBS0D7	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	870.679,88	BRLIGHDBS0D7	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	460.104,32	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.294.068,12	BRMGPRDBS068	brAAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/31	LOCALIZA	8.056.922,20	BRRENTDBS0K7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/30	NORTE EN	1.971.222,87	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.577.372,38	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	15/11/25	QUATA	4.416.941,20	BRQUATDBS019	-	-	A-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	15/12/35	MS 306	2.140.697,82	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	1.024.559,11	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	429.507,69	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	819.647,28	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	510.442,20	BRBCFBDBS040	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	510.442,20	BRBCFBDBS040	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	20/08/26	VAMOS	948.764,86	BRVAMODBS017	brAAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	499.904,76	BRSNGODBS0J1	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	1.016.066,59	BRSNGODBS0J1	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	1.000.825,59	BRSNGODBS0J1	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	1.744.430,77	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	435.600,00	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	204.911,82	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	512.821,65	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	1.530.276,32	BRBCFBDBS040	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	19/06/24	BNBBM	555.710,64	BRBNBRLF0F8	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	12/06/24	BNBBM	840.498,00	BRBNBRLF062	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	738.328,84	BRSBFCDBS002	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	1.767.829,62	BRSBFCDBS002	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/09/25	BRKA	1.846.214,20	BRBRKPDBS048	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/09/25	BRKA	613.671,20	BRBRKPDBS048	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	25/04/23	CELPA	2.556.118,53	BREQPADBS060	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/12/30	B2W	2.186.321,76	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/09/34	BRKA	988.996,13	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/10/36	PAMPASUL	2.456.211,85	BRUTPSDBS039	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	13/07/23	ECORODOV	2.085.266,51	BRERDVDBS0J7	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	15/05/23	LIGHT	2.096.081,19	BRLIGHDBS0D7	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	15/03/29	OMEGA GE	2.025.903,48	BROMGEDBS069	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	20/04/26	SMARTIFI	2.097.349,28	BRSMFTDBS045	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	30/09/23	USIMINAS	2.010.275,59	BRUSIMDBS005	brAAA+	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	30/09/23	USIMINAS	502.568,90	BRUSIMDBS005	brAAA+	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/31	CORSAN	1.522.644,89	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/26	CORSAN	1.022.190,33	BRRSANDBS030	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	15/12/30	MG050	513.659,91	BRRDVIDBS061	brAAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/06/21	15/04/28	PAMPASUL	1.353.957,84	BRUTPSDBS005	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/06/21	15/06/31	RIO PR	497.078,55	BRRIPRDBS030	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	27/11/25	GUAR	1.249.406,08	BRGUARDBS055	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAME	300.601,49	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	1.566.673,67	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAME	1.558.219,96	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	85.627,91	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	20/06/26	OURO VER	2.037.924,53	BROVSADBS0E8	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/06/21	15/09/34	BRKA	1.672.004,51	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/06/21	27/11/25	GUAR	1.364.897,40	BRGUARDBS055	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	15/12/35	MS 306	3.171.404,18	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/10/26	LIGHT	5.241.381,03	BRLIGHDBS0S5	brAAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/12/35	MS 306	2.773.921,53	BRCNRDDBS004	brAAA	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	1.115.805,25	BRLRENDBS0B4	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	235.977,05	BRLRENDBS0B4	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	07/07/21	15/03/29	CAGECE	1.730.023,94	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/07/28	VENSJOR	315.894,19	BRVSHJDBS001	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/07/28	VENSJOR	1.524.021,42	BRVSHJDBS001	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	259.901,71	BRVAMODBS033	brAAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	248.901,00	BRVAMODBS041	brAAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/03/29	CAGECE	2.575.905,34	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	4.938.511,86	BRVAMODBS041	brAAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	31/10/22	ITAU	1.312.916,61	BRBITALFIDB3	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	15/02/23	GETI	3.026.333,19	BRTIETDBS093	-	Aa1.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	15/12/22	COELCE	3.043.510,83	BRCOCEDBS077	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	3.056.294,93	BRBBDBCLTRQT74	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/07/29	GUARIROB	1.158.474,52	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	1.911.143,45	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	217.236,49	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/05/26	OMEGA GE	294.701,17	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	928.269,67	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.708.392,52	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/09/34	BRKA	452.424,75	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	482.700,23	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/05/26	OMEGA GE	868.173,71	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.507.405,17	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	2.210.860,91	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.105.430,46	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/09/34	BRKA	755.134,06	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/09/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	1.827.782,92	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	285.724,85	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	3.822.286,90	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/03/29	ANET	1.052.335,24	BRANETDBS002	brA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	11/03/25	BRML	3.017.912,57	BRBRMLDBS076	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	10/05/24	MULTIPLA	3.063.518,98	BRMULTDBS031	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	363.551,97	BRIGTADBS072	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	363.551,97	BRIGTADBS072	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	1.296.141,82	BRIGTADBS072	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/07/27	RT BANDE	2.271.126,57	BRRCBDDBS033	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/05/23	ELEKTRO	549.859,94	BREKTRDBS0F0	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/09/23	SONAE	2.991.494,55	BRALSCDBS036	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	15/02/31	CORSAN	2.694.066,37	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/07/30	PARANAGU	732.086,42	BRPASNDBS018	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/05/30	NORTE EN	1.833.584,36	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/10/30	LAME	1.985.196,76	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	1.987.934,86	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	728.442,50	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/05/25	INTERVIA	1.275.709,96	BRVIADBS074	-	-	-
FIM EMB I A	21/07/21	05/03/24	ENERG TR	1.279.176,58	BRETENDBS061	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/01/26	AERIS	1.206.452,02	BRAERIDBS006	brAA	-	AA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/07/27	RT BANDE	1.091.781,20	BRRCBDDBS033	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/29	OMEGA GE	1.024.094,21	BRMOMGEDBS069	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/08/26	VAMOS	1.033.910,42	BRVAMODBS017	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	15/12/30	MG050	1.540.979,72	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/07/21	15/03/29	ANET	2.630.838,11	BRANETDBS002	brA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	492.764,45	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.261.011,39	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	1.455.036,93	BRMLVDBS050	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	3.696.342,88	BRMLVDBS050	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/10/24	BKBR	1.416.885,32	BRBKBRDBS048	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/12/26	RD COLIN	2.129.771,59	BRCOLNDBS0C7	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/07/21	15/05/30	NORTE EN	1.017.328,14	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	02/08/21	15/01/31	ECHOENER	1.549.759,48	BRECHPDBS024	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	984.385,64	BRUNEGDBS007	brAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/08/21	15/04/27	MOV_PART	1.048.368,05	BRMOVDBS0E6	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	05/08/21	15/06/32	ENSINOP	688.033,64	BRCNSPDBS022	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	06/08/21	15/12/31	METRORIO	1.010.180,89	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/08/21	10/08/23	PARANA B	505.010,07	BRPRBCLFICE4	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.022.231,12	BRCNSANDBS040	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/06/27	AUTOPIST	1.530.341,09	BRAPRBDBS023	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/04/31	ELETROB	2.048.808,23	BRELETDBS057	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	11/08/21	15/08/31	CSAN	4.983.441,44	BRCNSANDBS057	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/08/21	14/08/23	ABC	1.007.480,26	BRABCLFI3Q1	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/08/21	15/07/31	ALGA	2.998.808,81	BRALGTDBS0F6	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	17/08/21	15/05/30	NORTE EN	3.085.496,40	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	18/08/21	15/12/31	METRORIO	1.024.455,18	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	15/12/31	METRORIO	1.032.141,34	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/08/21	15/05/44	CTEEP	936.623,80	BRTRPLDBS0D1	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/08/21	15/08/29	CEEE D	3.855.545,34	BRCEEDDBS019	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.010.613,12	BRRDORDBS0A0	AAA(bra)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/09/21	15/08/31	COMGAS	3.093.219,42	BRCGASDBS0B7	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/09/21	15/05/30	NORTE EN	501.482,93	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	660.153,51	BRGRRRDBS034	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	59.118,23	BRGRRRDBS034	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	295.591,13	BRGRRRDBS034	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	15/06/24	PROLAGOS	2.204.422,16	BRPRLGDBS037	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	15/04/26	ELETROB	2.007.866,24	BRELETDBS040	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	21/10/26	AUTOBAN	1.003.355,43	BRANHBDBS0F3	brAAA	-	-
FIM EMB I A	17/09/21	01/10/24	EQUATENE	1.434.511,57	BREQTLDBS036	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	17/09/21	15/03/28	BRISANET	1.403.075,20	BRBRSTDBS001	brA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.037.787,44	BRMOVDBS0G1	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.494.779,79	BRMOVDBS0H9	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/12/30	MG050	1.027.319,81	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/12/30	MG050	1.027.319,81	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	988.547,70	BRMOVDBS0H9	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/07/39	EDPM	1.979.553,15	BRMGSPDBS017	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	751.171,48	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	751.171,48	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	249.713,76	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	249.713,76	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	698.910,69	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	698.910,69	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	898.105,99	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	348.879,64	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	348.879,64	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.931.525,81	BRLCAMDBS0R2	brAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.980.397,53	BRLCAMDBS0R2	brAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	23/09/21	14/08/23	ABC	1.007.480,26	BRABCLFI3Q1	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	15/03/24	CCPR	2.004.963,41	BRCCPRDBS0D1	-	Abr	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	20/05/25	CEA MODA	2.062.440,18	BRCEABDBS011	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	15/03/24	AMPL	2.004.904,34	BRCBEEDBS0D0	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.000.891,38	BRBPANLF654	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	28/05/23	IGUATEMI	2.350.104,96	BRIGTADBS080	-	-	AAA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/09/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FIMEMB VI ACRED PRIV	27/09/21	15/01/26	LOCAMERI	1.855.399,03	BRLCAMDBS009	brAAA	-	-
FIMEMB VI ACRED PRIV	27/09/21	05/03/24	ENERG TR	2.002.761,44	BRETENDBS061	-	-	AAA(bra)
FIMEMB VI ACRED PRIV	27/09/21	10/08/23	PARANA B	1.010.020,14	BRPRBCLFICE4	-	-	-
FIMEMB VI ACRED PRIV	27/09/21	01/04/24	CNH	1.857.562,72	BRCNHCLFI317	-	-	-
FIMEMB VI ACRED PRIV	27/09/21	10/05/27	SABESP	1.156.568,32	BRSBSPDBS1B5	brAAA	-	-
FIMEMB VI ACRED PRIV	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	760.000,00	BRSIMHDBS044	brAA+	-	-
FIMEMB VI ACRED PRIV	30/09/21	15/01/31	SIMPAR	1.000.000,00	BRSIMHDBS036	brAA+	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	BR ELETRO FIDC S1	5.016.276,61	BR0402CTF000	-	-	Aasf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CELG DIST SN B	3.684.865,25	BRFCLGCTF015	-	-	AA-sf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CREDZ SN4	13.870,24	BRCRDZCTF074	brAA(sf)	-	Asf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CREDZ SN6	1.260.528,14	BRCRDZCTF0A0	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FARM SYN AGRO FIDC	4.040.763,38	BR032XCTF002	-	-	AAAsf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC	3.215.688,04	BRNGSCTF002	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SN3	5.290.271,90	BRVDCRCTF024	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SN5	700.216,74	BRVDCRCTF040	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SN6	1.400.460,69	BRVDCRCTF057	brAAA(sf)	-	-

Observação: Em setembro 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 **3.759.020.651,95**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.773.435.973,72	3.759.020.651,95	73,78%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACE	100,00%	2.008.554.945,55	3.759.020.651,95	53,43%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	764.881.028,17	3.007.216.566,37	20,35%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	751.804.141,59	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	375.902.070,80	0,00%	Enquadrado
% do PL em instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	939.755.162,99	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	939.755.162,99	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	716.254.568,54	2.631.314.411,55	19,05%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	939.755.162,99	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	97.753.804,09	751.804.141,59	2,60%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	31.498.299,22	563.853.120,20	0,84%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	751.804.141,59	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	120.993.682,91	375.902.070,80	3,22%	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 SETEMBRO DE 2021 À 30 DE SETEMBRO DE 2021



Bradesco

FIM EMB I A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
15/09/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Compra	2,3690%	2,2800%	1,9596%	2,8472%	0,0890%	NÃO
15/09/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	4,8195%	4,8185%	4,4496%	5,2246%	0,0010%	NÃO
15/09/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	4,8195%	4,8185%	4,4496%	5,2246%	0,0010%	NÃO
22/09/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Compra	2,3157%	2,4000%	1,9267%	2,6616%	-0,0843%	NÃO
29/09/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Venda	2,4511%	2,5022%	2,0432%	2,7872%	-0,0511%	NÃO
29/09/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Venda	2,4511%	2,5022%	2,0432%	2,7872%	-0,0511%	NÃO
29/09/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Venda	2,4511%	2,5022%	2,0432%	2,7872%	-0,0511%	NÃO
29/09/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Venda	2,4511%	2,5022%	2,0432%	2,7872%	-0,0511%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE SETEMBRO DE 2021 À 30 DE SETEMBRO DE 2021



Bradesco

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
06/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	4,5310%	4,5308%	4,0944%	5,4553%	0,0002%	NÃO
06/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2030	Venda	4,6710%	4,6800%	4,2847%	5,3860%	-0,0090%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2022	Compra	2,6191%	2,5802%	2,2587%	3,6452%	0,0389%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Compra	2,6346%	2,5802%	2,2587%	3,6452%	0,0544%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Compra	3,7446%	3,7270%	3,3907%	4,7719%	0,0176%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Compra	4,3065%	4,3471%	3,9322%	5,3340%	-0,0406%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	4,4275%	4,4890%	4,0197%	5,4299%	-0,0615%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	4,4275%	4,4890%	4,0197%	5,4299%	-0,0615%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2026	Compra	4,5590%	4,5726%	4,1430%	5,5048%	-0,0136%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	4,5685%	4,5726%	4,1430%	5,5048%	-0,0041%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	4,6545%	4,6442%	4,2440%	5,4701%	0,0103%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2030	Compra	4,6790%	4,6800%	4,3091%	5,4113%	-0,0010%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2035	Compra	4,7308%	4,7160%	4,3506%	5,3098%	0,0148%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2045	Compra	4,8518%	4,8352%	4,4792%	5,4150%	0,0166%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	4,8548%	4,8500%	4,4847%	5,3993%	0,0048%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2055	Compra	4,8758%	4,8700%	4,5074%	5,4090%	0,0058%	NÃO
13/09/2021	FIM EMB II A	BNP	GUIDE CT	LFT	01/09/2023	Compra	0,1593%	0,1536%	0,0411%	0,2176%	0,0057%	NÃO
13/09/2021	FIM EMB II A	BNP	ATIVA	LFT	01/03/2024	Venda	0,1624%	0,1595%	0,0823%	0,2250%	0,0029%	NÃO
16/09/2021	FIM EMB II A	BNP	ATIVA	NTN-B	15/05/2045	Venda	4,8155%	4,8100%	4,4628%	5,3987%	0,0055%	NÃO
16/09/2021	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/05/2023	Compra	3,4590%	3,4748%	3,1187%	4,0615%	-0,0158%	NÃO
16/09/2021	FIM EMB II A	BNP	TULL PRE	NTN-B	15/05/2023	Compra	3,4290%	3,4748%	3,1187%	4,0615%	-0,0458%	NÃO
17/09/2021	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	LFT	01/09/2023	Compra	0,1572%	0,1571%	0,0339%	0,2163%	0,0001%	NÃO
17/09/2021	FIM EMB II A	BNP	GUIDE CT	LFT	01/09/2023	Compra	0,1547%	0,1571%	0,0339%	0,2163%	-0,0024%	NÃO
17/09/2021	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	LFT	01/03/2024	Venda	0,1558%	0,1568%	0,0787%	0,2208%	-0,0010%	NÃO
30/09/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Compra	3,6490%	3,7271%	3,3996%	4,0328%	-0,0781%	NÃO



RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE SETEMBRO DE 2021 À 30 DE SETEMBRO DE 2021



Bradesco

FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA					
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
03/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	LFT	01/09/2025	Venda	0,2208%	0,2143%	0,1660%	0,2856%	0,0065%	NÃO
03/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	LFT	01/09/2025	Venda	0,2208%	0,2143%	0,1660%	0,2856%	0,0065%	NÃO
03/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	LFT	01/09/2025	Venda	0,2208%	0,2143%	0,1660%	0,2856%	0,0065%	NÃO
03/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/08/2040	Venda	4,8510%	4,8439%	4,4484%	5,4130%	0,0071%	NÃO
03/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/08/2040	Venda	4,8510%	4,8439%	4,4484%	5,4130%	0,0071%	NÃO
03/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/08/2040	Venda	4,8510%	4,8439%	4,4484%	5,4130%	0,0071%	NÃO
03/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/05/2055	Venda	4,8810%	4,9041%	4,5118%	5,4119%	-0,0231%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	LFT	01/09/2025	Venda	0,2091%	0,2136%	0,1636%	0,2834%	-0,0045%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/08/2028	Venda	4,6721%	4,6300%	4,2093%	5,4342%	0,0421%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/08/2028	Venda	4,6711%	4,6300%	4,2093%	5,4342%	0,0411%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/08/2030	Venda	4,7127%	4,6800%	4,2847%	5,3860%	0,0327%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/08/2050	Venda	4,9010%	4,8873%	4,5167%	5,4303%	0,0137%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/05/2055	Venda	4,9210%	4,9019%	4,5359%	5,4362%	0,0191%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/05/2055	Venda	4,9210%	4,9019%	4,5359%	5,4362%	0,0191%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/05/2055	Venda	4,9210%	4,9019%	4,5359%	5,4362%	0,0191%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/05/2055	Venda	4,9110%	4,9019%	4,5359%	5,4362%	0,0091%	NÃO
06/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	CAPITALP	NTN-B	15/05/2055	Venda	4,9110%	4,9019%	4,5359%	5,4362%	0,0091%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2023	Venda	0,1555%	0,1513%	0,0465%	0,2115%	0,0042%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/03/2024	Venda	0,1655%	0,1603%	0,0811%	0,2271%	0,0052%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/03/2024	Venda	0,1655%	0,1603%	0,0811%	0,2271%	0,0052%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/03/2024	Venda	0,1655%	0,1603%	0,0811%	0,2271%	0,0052%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2024	Venda	0,1704%	0,1620%	0,1112%	0,2450%	0,0084%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2024	Venda	0,1704%	0,1620%	0,1112%	0,2450%	0,0084%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2024	Venda	0,1704%	0,1620%	0,1112%	0,2450%	0,0084%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/03/2025	Venda	0,2054%	0,1993%	0,1373%	0,2642%	0,0061%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/03/2025	Venda	0,2054%	0,1993%	0,1373%	0,2642%	0,0061%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2204%	0,2129%	0,1628%	0,2825%	0,0075%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2204%	0,2129%	0,1628%	0,2825%	0,0075%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2204%	0,2129%	0,1628%	0,2825%	0,0075%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/03/2026	Venda	0,2404%	0,2352%	0,1875%	0,3016%	0,0052%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LTN	01/01/2024	Venda	9,6410%	9,7965%	8,7606%	10,8423%	-0,1555%	NÃO
08/09/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	NTN-B	15/08/2040	Venda	4,8610%	4,9347%	4,4753%	5,4400%	-0,0737%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE SETEMBRO DE 2021 À 30 DE SETEMBRO DE 2021



Bradesco

FIM EMB VI A CRED PRIV

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA					
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
10/09/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	LFT	01/09/2022	Compra	0,0292%	0,0296%	-0,0154%	0,1432%	-0,0004%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/08/2024	Compra	4,3070%	4,3471%	3,9322%	5,3340%	-0,0401%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	4,7090%	4,5726%	4,1430%	5,5048%	0,1364%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2026	Compra	4,5700%	4,5726%	4,1430%	5,5048%	-0,0026%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/08/2026	Compra	4,5700%	4,5726%	4,1430%	5,5048%	-0,0026%	NÃO
10/09/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2028	Compra	4,6500%	4,6442%	4,2440%	5,4701%	0,0058%	NÃO
28/09/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TERRA	NTN-B	15/05/2025	Compra	4,4590%	4,4626%	4,1534%	4,7591%	-0,0036%	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.