



RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO E RENTABILIDADE



Maio/2020





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 Resumo de Risco



Bradesco

Relatório Resumo de Risco - EMBRAER PREV

Data Base: 29/05/2020

| Fundo | Risco (*) | | Duration | | Tracking Error | Stress Testing Próprio | | | Stress Testing BM&F | |
|-----------------------------|------------------|------------------|-----------------|-----------------|----------------|------------------------|-------------------|--------------------|---------------------|--------------------|
| | VaR | B-VaR | Duration (d.u.) | Duration (d.c.) | TE | CEN1 | CEN2 | CEN3 | ALTA | BAIXA |
| FI RF EMB I | 88.203.006,8940 | 90.331.580,6200 | 2.725 | 3.962 | | 86.134.589,2285 | (25.721.262,2920) | (143.846.107,3607) | (148.509.422,5301) | 42.311.311,6891 |
| FI RF EMB I A | 39.471,8771 | 39.471,8771 | 564 | 816 | | 22.787,2619 | (11.811,8021) | (34.979,0746) | (1.010.379,1302) | 1.252.709,2634 |
| FI RF EMB II | 88.106.936,2782 | 90.364.212,3145 | 2.339 | 3.399 | | 87.577.894,1986 | (25.901.750,2316) | (144.154.440,1517) | (148.441.349,9479) | 42.601.881,2269 |
| FIM EMB II A | 542.995,5700 | 542.995,5700 | 681 | 987 | | 897.227,0598 | (453.673,5631) | (1.375.557,8171) | (4.772.390,7799) | 1.007.551,1467 |
| FIM EMB III A IMOBILIÁRIO | 2.580.667,5829 | 2.361.499,7751 | | | 7,51% | 1.613.722,2225 | 48.125,5738 | (1.991.966,7095) | 768.737,6415 | (2,2102) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | 3.142.476,0626 | 3.551.054,0474 | 597 | 865 | | 1.372.076,4635 | (59.331,8481) | (2.061.565,2468) | (5.985.743,5139) | (369.944,0838) |
| FIM EMB IV A | 1.460.783,6000 | 1.460.783,6000 | 1.187 | 1.723 | | 3.942.609,0299 | (272.776,6355) | (4.725.269,3670) | (7.865.633,3777) | 3.975.867,9850 |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | 6.247.807,4270 | 6.699.474,4687 | 668 | 968 | | 2.271.750,1242 | (959.756,2410) | (4.973.907,4577) | (12.212.867,8635) | (763.341,7775) |
| FIA RVA EMB II | 146.077.416,0507 | 40.451.615,5213 | | | 1,31% | 172.231.615,5525 | 23.610.889,5202 | (138.486.470,6031) | 83.761.832,5929 | (229.718.628,1337) |
| EMBRAER PREV RENDA FIXA | 184.931.662,4270 | 190.540.964,4293 | | | | 177.855.080,0116 | (52.418.607,5352) | (295.164.446,2557) | (315.822.280,9990) | 85.032.617,7456 |
| EMBRAER PREV RENDA VARIÁVEL | 146.077.416,0507 | 40.451.615,5213 | | | 1,31% | 172.231.615,5525 | 23.610.889,5202 | (138.486.470,6031) | 83.761.832,5929 | (229.718.628,1337) |

* Valores calculados para 21 dias e 95% de confiança.



2.2. Relatório Detalhado Risco



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Consolidado

Data: 29/05/2020

EMBRAER PREV - SOC DE PREV COMPLEMENTAR

Dados Gerais

| | | | |
|------|------------------|------------|-----------|
| PL: | 3.183.222.000,41 | VAR / PL: | 11,004% |
| VAR: | 350.292.294,23 | ETL / PL: | 13,7999% |
| ETL: | 439.280.819,63 | VAR / CDI: | 96998,28% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|------------------|----------|-----------------|------------|------------------|
| ALTA 1: | (279.579.618,98) | BAIXA 1: | (11.097.240,04) | Cenário 1: | 267.459.979,75 |
| | | | | Cenário 2: | (36.972.342,66) |
| | | | | Cenário 3: | (365.447.650,17) |

Parâmetros do Cálculo

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

| Produto | MTM | VAR Tot. | Comp. VAR | Comp. VAR (%) | Cenário 1 | Cenário 2 | Cenário 3 |
|--------------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|-----------------|
| CAIXA | 54.164,12 | 241,67 | 119,81 | 0,00% | 193,98 | 95,93 | (37,93) |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | (2.362.059,37) | 10.539,12 | (5.224,82) | 0,00% | (8.459,25) | (4.183,42) | 1.653,99 |
| ABEV3 | 18.977.510,11 | 4.823.034,82 | 4.186.035,79 | 1,20% | 952.147,38 | (384.319,72) | (2.075.518,07) |
| B3SA3 | 36.394.375,87 | 9.628.938,44 | 8.878.532,23 | 2,53% | 5.322.830,18 | (715.436,24) | (7.612.004,89) |
| BBAS3 | 14.388.167,01 | 5.169.892,39 | 4.912.677,63 | 1,40% | 1.831.302,88 | (1.507.745,12) | (5.004.793,52) |
| BBDC4 | 44.045.325,83 | 10.936.377,82 | 10.124.730,82 | 2,89% | 2.951.694,83 | (6.386.834,57) | (16.272.409,09) |
| BEEF3 | 9.273.330,01 | 5.123.816,04 | 4.127.408,38 | 1,18% | 3.540.728,77 | 4.513.396,04 | 5.969.436,05 |
| BMLC11B | 471.565,00 | 2.104,05 | 1.043,09 | 0,00% | 1.688,82 | 835,18 | (330,21) |
| BPML11 | 768.240,00 | 5.855,28 | 2.837,50 | 0,00% | 2.751,30 | 1.360,62 | (537,95) |
| BRDT3 | 12.427.454,01 | 5.581.907,63 | 5.290.368,07 | 1,51% | 4.466.004,95 | (372.487,03) | (4.844.250,59) |
| BRML3 | 8.966.940,01 | 3.156.966,49 | 2.969.834,29 | 0,85% | 112.632,87 | (1.030.197,53) | (2.369.980,13) |
| BRPR3 | 9.201.990,01 | 2.405.615,38 | 2.302.697,63 | 0,66% | (26.849,40) | (1.187.668,97) | (2.547.441,67) |
| BTLG11 | 1.904.515,20 | 8.600,52 | 4.299,29 | 0,00% | 6.820,65 | 3.373,07 | (1.333,61) |
| BTOW3 | 27.738.213,47 | 13.811.608,96 | 11.620.048,03 | 3,32% | 14.152.537,99 | 11.232.436,08 | 7.554.041,18 |
| CCRO3 | 18.078.896,01 | 5.771.103,00 | 5.295.771,58 | 1,51% | 2.816.638,28 | (1.377.536,36) | (5.803.004,47) |
| CDB31957FN7 | 236.732,80 | 1.056,26 | 523,65 | 0,00% | 847,81 | 419,27 | (165,77) |
| CEOC11 | 346.901,40 | 1.547,82 | 767,34 | 0,00% | 1.242,36 | 614,39 | (242,91) |
| CIEL3 | 6.056.775,00 | 1.369.328,38 | 907.150,18 | 0,26% | (177.024,00) | (1.554.526,48) | (2.938.063,61) |
| CNES11 | 1.296.519,18 | 5.784,86 | 2.867,87 | 0,00% | 4.643,23 | 2.296,25 | (907,87) |
| CPFE3 | 24.362.096,02 | 6.360.133,08 | 6.238.865,47 | 1,78% | 3.299.161,91 | 253.301,99 | (3.391.538,32) |
| CRFB3 | 5.509.072,00 | 619.548,74 | (198.056,78) | -0,06% | (294.592,83) | (716.117,88) | (1.240.491,61) |
| CSNA3 | 5.323.940,00 | 2.818.380,89 | 2.636.539,42 | 0,75% | 1.557.836,85 | 554.921,49 | (588.516,70) |
| ELET3 | 9.716.798,01 | 4.129.291,33 | 3.810.702,31 | 1,09% | 1.626.485,91 | (1.274.761,29) | (4.091.708,82) |
| ELET6 | 10.497.615,01 | 3.858.349,58 | 3.477.530,13 | 0,99% | 1.461.455,95 | (1.404.461,46) | (4.257.612,45) |
| ENG11 | 5.786.226,00 | 1.596.600,11 | 1.443.413,85 | 0,41% | 815.772,32 | (76.759,19) | (1.109.540,36) |
| FIGS11 | 746.771,25 | 183.883,92 | 172.030,51 | 0,05% | 40.352,05 | (19.552,00) | (94.490,42) |
| FVPQ11 | 1.589.327,25 | 7.091,32 | 3.515,55 | 0,00% | 5.691,86 | 2.814,84 | (1.112,90) |
| GRLV11 | 834.198,05 | 137.582,57 | 109.691,57 | 0,03% | 61.637,25 | (13.339,18) | (106.219,86) |
| HAPV3 | 23.973.633,07 | 7.595.447,46 | 6.332.284,60 | 1,81% | 5.691.520,43 | (995.571,99) | (7.796.122,69) |
| HSM11 | 4.588.624,35 | 1.128.825,58 | 997.966,45 | 0,28% | (2.001,44) | (81.408,05) | (188.234,01) |
| HYPE3 | 5.234.375,00 | 844.285,24 | 578.946,08 | 0,17% | 89.758,38 | (563.277,12) | (1.332.144,46) |
| ITUB4 | 35.287.540,49 | 7.784.573,47 | 7.204.218,88 | 2,06% | 2.680.948,86 | (2.426.367,26) | (8.342.976,59) |
| JBSS3 | 13.712.600,01 | 3.707.964,79 | 2.456.736,50 | 0,70% | 602.233,98 | 2.075.423,57 | 4.349.068,08 |
| JRDM11 | 774.554,50 | 180.463,16 | 152.847,31 | 0,04% | 37.675,45 | 14.893,49 | (15.359,32) |
| KLBN11 | 4.823.775,00 | 1.765.472,97 | 1.421.664,44 | 0,41% | 555.840,83 | 1.484.986,04 | 3.027.488,69 |
| LAME4 | 9.129.780,01 | 3.762.203,97 | 3.407.888,63 | 0,97% | 3.086.499,88 | 1.944.740,21 | 549.124,65 |
| LREN3 | 13.168.722,01 | 3.897.106,86 | 3.526.717,63 | 1,01% | 1.405.383,10 | (918.146,13) | (3.518.978,08) |
| LVB11 | 48.760,00 | 217,56 | 107,86 | 0,00% | 174,62 | 86,36 | (34,14) |
| MALL11 | 2.758.693,50 | 758.920,53 | 690.115,89 | 0,20% | 90.304,71 | (61.702,96) | (257.401,76) |
| MAXR11 | 617.907,42 | 2.757,00 | 1.366,80 | 0,00% | 2.212,91 | 1.094,37 | (432,68) |
| MDIA3 | 6.136.218,00 | 1.833.419,85 | 1.608.836,07 | 0,46% | 907.867,41 | 740.193,26 | 516.464,92 |
| MGLU3 | 12.926.025,01 | 6.121.440,72 | 5.797.263,72 | 1,65% | 4.944.059,67 | 3.472.606,73 | 1.648.187,20 |
| NTCO3 | 7.102.668,00 | 3.279.089,98 | 3.014.378,17 | 0,86% | 2.224.685,71 | 442.133,27 | (1.464.320,75) |
| PCAR3 | 3.425.855,00 | 559.073,74 | 332.643,64 | 0,09% | (56.955,06) | (289.353,27) | (582.799,94) |
| PETR3 | 11.939.192,01 | 6.995.137,41 | 6.586.140,35 | 1,88% | 3.855.089,45 | 1.127.756,42 | (1.866.941,02) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Consolidado

Data: 29/05/2020

EMBRAER PREV - SOC DE PREV COMPLEMENTAR

Dados Gerais

| | | | |
|------|------------------|------------|-----------|
| PL: | 3.183.222.000,41 | VAR / PL: | 11,004% |
| VAR: | 350.292.294,23 | ETL / PL: | 13,7999% |
| ETL: | 439.280.819,63 | VAR / CDI: | 96998,28% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|------------------|----------|-----------------|------------|------------------|
| ALTA 1: | (279.579.618,98) | BAIXA 1: | (11.097.240,04) | Cenário 1: | 267.459.979,75 |
| | | | | Cenário 2: | (36.972.342,66) |
| | | | | Cenário 3: | (365.447.650,17) |

Parâmetros do Cálculo

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

| Produto | MTM | VAR Tot. | Comp. VAR | Comp. VAR (%) | Cenário 1 | Cenário 2 | Cenário 3 |
|-----------------------------|------------------|---------------|----------------|---------------|----------------|----------------|----------------|
| PETR4 | 27.327.260,45 | 14.774.121,94 | 13.827.346,10 | 3,95% | 7.417.785,90 | 2.246.295,84 | (3.624.992,34) |
| RADL3 | 8.319.720,01 | 1.006.230,03 | 808.367,55 | 0,23% | 261.250,82 | 159.875,50 | 22.634,38 |
| RAIL3 | 13.199.949,01 | 2.816.193,81 | 2.109.223,24 | 0,60% | 463.897,99 | 192.035,17 | (172.540,26) |
| RBSG11 | 760.117,80 | 3.391,52 | 1.681,36 | 0,00% | 2.722,21 | 1.346,24 | (532,26) |
| RCRB11 | 2.192.022,00 | 9.780,44 | 4.848,70 | 0,00% | 7.850,30 | 3.882,27 | (1.534,93) |
| RENT3 | 6.051.438,00 | 2.696.487,67 | 2.513.723,43 | 0,72% | 1.554.163,71 | (104.745,49) | (1.810.263,85) |
| RNGO11 | 450.213,40 | 2.008,78 | 995,86 | 0,00% | 1.612,35 | 797,37 | (315,25) |
| SAPR11 | 9.480.240,01 | 2.695.962,77 | 2.460.678,41 | 0,70% | 1.471.846,58 | (691.247,16) | (2.984.358,40) |
| SDIL11 | 399.744,80 | 84.538,03 | 69.977,62 | 0,02% | (1.011,40) | (11.411,27) | (25.256,91) |
| SULM15 | 1.854,71 | 8,28 | 4,10 | 0,00% | 6,64 | 3,28 | (1,30) |
| SUZB3 | 11.419.772,01 | 3.345.044,35 | 2.210.393,24 | 0,63% | 475.503,45 | 2.560.606,45 | 6.032.186,82 |
| TEPP11 | 1.235.482,36 | 5.512,52 | 2.732,86 | 0,00% | 4.424,64 | 2.188,15 | (865,13) |
| TIMP3 | 7.018.794,00 | 1.202.756,27 | 1.036.975,52 | 0,30% | 606.453,84 | (356.469,09) | (1.484.395,41) |
| TOTS3 | 18.056.400,01 | 6.366.009,99 | 5.953.842,30 | 1,70% | 4.742.766,73 | (267.448,99) | (5.405.776,39) |
| TRXF11 | 1.164.336,80 | 5.340,89 | 2.694,26 | 0,00% | 4.169,84 | 2.062,14 | (815,31) |
| VALE3 | 58.840.472,59 | 15.966.573,58 | 13.099.847,80 | 3,74% | 6.672.276,83 | 7.637.370,39 | 8.986.600,72 |
| VIVT4 | 8.842.392,01 | 917.676,47 | 495.984,65 | 0,14% | 88.723,25 | (702.717,93) | (1.677.199,79) |
| WEGE3 | 6.053.184,00 | 1.445.106,04 | 992.494,26 | 0,28% | 909.039,26 | (284.153,91) | (1.597.354,67) |
| YDUQ3 | 3.318.564,00 | 1.591.949,09 | 1.463.821,90 | 0,42% | 783.363,61 | (296.401,70) | (1.332.370,20) |
| INDM20 | 16.710.336,00 | 5.265.179,11 | 5.140.114,64 | 1,47% | 2.376.123,44 | 29.595,50 | (2.799.032,07) |
| WINM20 | 5.848.617,60 | 1.842.812,69 | 1.799.040,12 | 0,51% | 831.643,20 | 10.358,42 | (979.661,23) |
| DI1M20 | 263.470.104,23 | 1.180.061,78 | 584.605,30 | 0,17% | 948.407,90 | 464.097,65 | (192.031,34) |
| DI1N20 | (825.710.311,15) | 3.862.421,87 | (1.951.206,82) | -0,56% | (3.261.617,27) | (1.303.191,23) | 1.052.484,77 |
| DI1V20 | 388.644.402,75 | 1.964.890,79 | 1.076.008,70 | 0,31% | 1.903.166,43 | 421.077,51 | (1.068.036,20) |
| DI1F21 | 123.375.061,67 | 635.210,82 | 417.165,98 | 0,12% | 729.312,83 | 68.385,95 | (533.215,32) |
| DI1J21 | 55.551.098,55 | 327.013,13 | 230.919,12 | 0,07% | 388.544,28 | (533,11) | (333.133,01) |
| DI1F22 | (25.969.376,67) | 369.146,78 | (256.006,76) | -0,07% | (305.915,07) | 64.594,35 | 346.140,64 |
| DI1F23 | (124.149.842,48) | 4.059.533,71 | (3.301.897,21) | -0,94% | (2.635.048,36) | 908.406,90 | 3.414.205,83 |
| DI1N23 | 270.236.842,40 | 11.394.392,20 | 9.434.777,57 | 2,69% | 7.329.679,06 | (2.782.063,81) | (9.772.747,55) |
| DI1F24 | (86.661.232,41) | 4.375.646,08 | (3.534.897,28) | -1,01% | (2.908.275,29) | 1.170.999,62 | 3.939.768,54 |
| DI1F27 | 577.719,67 | 57.808,50 | 48.612,49 | 0,01% | 44.383,79 | (19.843,13) | (60.189,66) |
| DOLM20 | 1.602.255,38 | 168.875,25 | (104.829,88) | -0,03% | 23.849,16 | (11.567,31) | 418.100,83 |
| COMPROMISSADA | 346.997.599,29 | 1.554.174,83 | 769.941,76 | 0,22% | 1.249.080,10 | 611.229,77 | (252.910,72) |
| DE252 ALUPAR CDI - ALUP17 | 2.667.520,49 | 12.679,41 | 8.825,20 | 0,00% | 11.955,12 | 3.497,19 | (5.467,68) |
| DE252 AMPLA EN CDI - AMPL19 | 1.246.117,78 | 5.535,65 | 2.561,35 | 0,00% | 4.100,94 | 2.396,25 | (308,56) |
| DE252 DASA CDI - DASAB0 | 2.089.048,89 | 13.016,84 | (4.396,71) | 0,00% | 308,93 | 7.336,12 | 9.147,33 |
| DE252 ENERSUL CDI - ESUL18 | 950.983,69 | 4.721,00 | 753,67 | 0,00% | 2.374,39 | 2.223,28 | 939,20 |
| DE252 GETI CDI - TIET19 | 2.434.248,27 | 52.386,42 | 45.009,31 | 0,01% | 49.777,03 | (15.276,43) | (56.647,55) |
| DE252 GUAR CDI - GUAR11 | 1.336.881,69 | 6.066,15 | 2.666,19 | 0,00% | 4.327,12 | 2.608,40 | (219,62) |
| DE252 LAME CDI - LAMEA1 | 729.654,03 | 3.203,24 | 1.827,98 | 0,00% | 2.859,85 | 1.164,05 | (891,33) |
| DE252 LOCALIZA CDI - LORTA1 | 1.158.680,17 | 5.782,20 | 1.538,16 | 0,00% | 3.092,10 | 2.602,42 | 822,65 |
| DE252 MOV_PART CDI - MOV133 | 1.376.166,53 | 6.120,47 | 3.021,22 | 0,00% | 4.928,47 | 2.437,31 | (963,63) |
| DE252 NATURA CDI - NATU27 | 1.774.631,87 | 7.892,17 | 3.932,22 | 0,00% | 6.423,35 | 3.107,61 | (1.348,05) |
| DE252 NCF PART CDI - NCFP13 | 3.059.765,65 | 13.618,19 | 6.312,04 | 0,00% | 10.142,21 | 5.845,96 | (870,36) |
| DE252 SABEREDU CDI - SSED11 | 1.061.702,72 | 4.722,50 | 2.338,25 | 0,00% | 3.816,43 | 1.872,98 | (765,42) |
| DE252 TELEF BR CDI - VIVT15 | 5.303.458,77 | 25.591,25 | 7.933,84 | 0,00% | 15.231,47 | 11.349,65 | 2.094,90 |
| DE252 USIMINAS CDI - USIM27 | 5.501.213,33 | 27.524,29 | 20.787,52 | 0,01% | 26.748,79 | 6.141,35 | (14.419,21) |
| LF selic | 12.452.988,81 | 78.082,55 | (23.653,61) | -0,01% | 5.169,88 | 42.696,34 | 52.819,43 |
| LFSNB VOTORA CDI | 2.211.308,15 | 11.012,66 | 2.746,42 | 0,00% | 5.376,09 | 5.247,21 | 2.417,87 |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Consolidado

Data: 29/05/2020

EMBRAER PREV - SOC DE PREV COMPLEMENTAR

Dados Gerais

| | | | |
|------|------------------|------------|-----------|
| PL: | 3.183.222.000,41 | VAR / PL: | 11,004% |
| VAR: | 350.292.294,23 | ETL / PL: | 13,7999% |
| ETL: | 439.280.819,63 | VAR / CDI: | 96998,28% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|----------------|-------------------------|-----------------|------------------------|-------------------|-------------------------|
| ALTA 1: | (279.579.618,98) | BAIXA 1: | (11.097.240,04) | Cenário 1: | 267.459.979,75 |
| | | | | Cenário 2: | (36.972.342,66) |
| | | | | Cenário 3: | (365.447.650,17) |

Parâmetros do Cálculo

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

| Produto | MTM | VAR Tot. | Comp. VAR | Comp. VAR (%) | Cenário 1 | Cenário 2 | Cenário 3 |
|--------------------------------|----------------|--------------|--------------|---------------|--------------|--------------|----------------|
| LFT | 336.081.234,25 | 1.543.039,93 | 761.134,05 | 0,22% | 1.203.609,41 | 595.229,85 | (235.333,47) |
| CMTR33 | 9.623.519,48 | 177.221,39 | 155.684,33 | 0,04% | 58.284,11 | 8.332,80 | (59.657,51) |
| CPT11 | 4.966.704,10 | 123.869,07 | 114.054,77 | 0,03% | 41.016,61 | (33,01) | (52.327,47) |
| CRI HABITASE IPCA | 5.006.958,95 | 177.482,49 | 162.567,23 | 0,05% | 69.443,39 | (11.106,91) | (107.184,25) |
| CRI HABITASE IPCA | 25.699.545,11 | 1.483.131,40 | 1.352.020,09 | 0,39% | 544.602,76 | (118.158,38) | (997.342,83) |
| CRI HABITASE IPCA | 10.438.415,49 | 318.994,89 | 294.693,20 | 0,08% | 120.748,63 | (12.959,06) | (179.192,97) |
| CRI RB CAPIT IPCA M D | 10.189.219,72 | 407.355,28 | 375.915,25 | 0,11% | 183.306,17 | (35.894,23) | (301.912,54) |
| DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23 | 13.531.732,79 | 623.384,63 | 570.735,05 | 0,16% | 251.387,74 | (51.338,19) | (425.745,82) |
| DE252 CART - IPCA CART22 | 23.164.641,30 | 889.899,78 | 819.422,68 | 0,23% | 303.392,13 | (38.964,11) | (497.042,08) |
| DE252 CCR IPCA - CCRDD1 | 5.155.169,81 | 224.123,85 | 204.260,87 | 0,06% | 82.163,97 | (14.519,27) | (135.846,89) |
| DE252 CEMIG - IPCA CMTD23 | 8.929.270,18 | 127.216,34 | 104.842,61 | 0,03% | 46.281,96 | 10.580,35 | (38.073,96) |
| DE252 CEMIG - IPCA CMTD33 | 2.407.118,73 | 92.532,33 | 85.260,23 | 0,02% | 31.319,71 | (3.973,87) | (51.198,98) |
| DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17 | 40.696.327,42 | 2.311.453,79 | 2.093.145,80 | 0,60% | 1.442.355,94 | 37.720,06 | (2.616.922,07) |
| DE252 CSMG IPCA - CSMGC3 | 13.955.253,41 | 576.163,31 | 528.008,47 | 0,15% | 215.419,63 | (36.951,31) | (351.245,13) |
| DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24 | 20.600.226,86 | 524.639,86 | 483.023,46 | 0,14% | 169.821,27 | 1.450,00 | (226.501,29) |
| DE252 DUKE GEP IPCA GEPA25 | 1.751.965,65 | 24.993,94 | 20.575,31 | 0,01% | 9.106,95 | 2.065,77 | (7.536,56) |
| DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17 | 11.788.066,31 | 530.958,29 | 485.904,48 | 0,14% | 212.434,66 | (42.521,84) | (357.185,21) |
| DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36 | 3.436.779,88 | 149.415,90 | 136.173,91 | 0,04% | 54.775,98 | (9.679,51) | (90.564,59) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT11 | 4.193.935,77 | 89.342,91 | 80.875,75 | 0,02% | 28.665,63 | 2.442,14 | (33.182,86) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT21 | 1.214.478,25 | 21.441,53 | 18.751,15 | 0,01% | 7.186,91 | 1.113,10 | (7.155,90) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT31 | 2.551.577,21 | 36.432,27 | 31.049,06 | 0,01% | 15.003,97 | 2.376,78 | (14.775,90) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT41 | 4.278.960,08 | 82.501,32 | 71.221,17 | 0,02% | 27.558,22 | 3.107,72 | (30.125,23) |
| DE252 IGUAATEMI - IPCA IGTA24 | 6.184.304,05 | 88.108,49 | 72.612,72 | 0,02% | 32.054,32 | 7.327,82 | (26.369,56) |
| DE252 IMED - IPCA SULM23 | 2.178.834,51 | 41.325,70 | 36.792,81 | 0,01% | 13.944,37 | 1.550,05 | (14.831,60) |
| DE252 JSLG - IPCA JSML36 | 606.265,57 | 3.869,13 | 1.665,05 | 0,00% | 3.050,52 | 753,95 | (2.352,89) |
| DE252 LAME - IPCA LAME38 | 15.299.563,41 | 159.594,20 | 121.124,39 | 0,03% | 80.521,62 | 17.705,50 | (67.615,75) |
| DE252 LAME IPCA - LAMEB1 | 9.016.711,51 | 358.327,78 | 327.835,69 | 0,09% | 114.985,29 | (14.096,41) | (187.505,46) |
| DE252 LIGHT IPCA - LIGHC2 | 13.655.828,14 | 87.150,21 | 37.504,38 | 0,01% | 68.711,33 | 16.982,32 | (52.997,64) |
| DE252 LIGHT IPCA - LSVE29 | 2.762.739,23 | 65.299,99 | 60.189,71 | 0,02% | 21.836,38 | 420,23 | (27.562,33) |
| DE252 PETR IPCA - PETR45 | 15.645.108,63 | 625.575,95 | 570.724,00 | 0,16% | 221.734,32 | (33.621,96) | (359.617,04) |
| DE252 RAZEN E - IPCA RESA31 | 500.397,71 | 7.723,99 | 4.828,68 | 0,00% | 2.678,40 | 562,44 | (2.314,71) |
| DE252 RD COLIN - IPCA RDCC24 | 1.936.072,74 | 29.884,66 | 18.682,49 | 0,01% | 10.362,89 | 2.176,11 | (8.955,75) |
| DE252 RD COLIN - IPCA RDCC34 | 12.733.273,60 | 257.797,87 | 238.134,84 | 0,07% | 113.003,90 | (6.762,78) | (136.700,62) |
| DE252 SABESP - IPCA SBESC7 | 13.894.322,79 | 313.790,72 | 286.432,69 | 0,08% | 99.803,84 | 6.330,42 | (120.557,73) |
| DE252 SANEPAR - IPCA SAPR23 | 767.878,59 | 10.719,43 | 8.823,64 | 0,00% | 4.026,11 | 893,39 | (3.371,24) |
| DE252 TRANS AL - IPCA TAEE23 | 3.404.296,38 | 52.547,73 | 32.850,39 | 0,01% | 18.221,61 | 3.826,37 | (15.747,36) |
| DE252 TRANS AL - IPCA TAEE33 | 14.682.650,60 | 505.741,79 | 466.255,76 | 0,13% | 168.922,22 | (16.268,67) | (264.835,39) |
| DEBI ELETROB IPCA - ELET42 | 12.206.744,90 | 759.579,06 | 688.985,16 | 0,20% | 451.857,70 | (120.760,55) | (808.656,22) |
| DEBI ENERGMIR IPCA - ENM21 | 1.113.959,10 | 53.218,62 | 48.815,78 | 0,01% | 24.245,00 | (5.447,92) | (41.494,43) |
| DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12 | 27.527.053,58 | 1.680.989,77 | 1.524.425,88 | 0,44% | 1.086.720,43 | (309.471,34) | (1.881.607,16) |
| DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21 | 1.874.106,87 | 85.991,02 | 78.960,06 | 0,02% | 38.584,51 | (8.370,41) | (65.511,23) |
| DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16 | 6.372.264,17 | 390.643,25 | 354.905,18 | 0,10% | 230.810,67 | (59.359,46) | (419.486,83) |
| ECCR32 | 9.794.826,84 | 198.284,10 | 173.598,77 | 0,05% | 65.525,23 | 6.223,88 | (74.336,40) |
| ENMA24 | 4.162.957,83 | 15.885,11 | 6.076,26 | 0,00% | 18.322,49 | 6.132,73 | (10.382,95) |
| LFS B.BRASIL IPCA | 10.518.791,07 | 52.219,99 | 17.969,94 | 0,01% | 37.880,20 | 18.553,21 | (7.830,38) |
| LFS ITAU IPCA | 4.540.724,77 | 134.510,55 | 123.195,54 | 0,04% | 38.343,63 | (22,41) | (52.074,17) |
| LFS ITAU IPCA M D | 719.721,93 | 23.035,90 | 21.169,57 | 0,01% | 6.563,66 | (180,31) | (9.319,47) |
| LFS ITAU IPCA M D | 3.598.609,65 | 115.179,52 | 105.847,84 | 0,03% | 32.818,32 | (901,56) | (46.597,33) |
| LFS ITAU IPCA M D | 8.636.663,16 | 276.430,86 | 254.034,81 | 0,07% | 78.763,97 | (2.163,75) | (111.833,59) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Consolidado

Data: 29/05/2020

EMBRAER PREV - SOC DE PREV COMPLEMENTAR

Dados Gerais

| | | | |
|------|------------------|------------|-----------|
| PL: | 3.183.222.000,41 | VAR / PL: | 11,004% |
| VAR: | 350.292.294,23 | ETL / PL: | 13,7999% |
| ETL: | 439.280.819,63 | VAR / CDI: | 96998,28% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|------------------|----------|-----------------|------------|------------------|
| ALTA 1: | (279.579.618,98) | BAIXA 1: | (11.097.240,04) | Cenário 1: | 267.459.979,75 |
| | | | | Cenário 2: | (36.972.342,66) |
| | | | | Cenário 3: | (365.447.650,17) |

Parâmetros do Cálculo

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

| Produto | MTM | VAR Tot. | Comp. VAR | Comp. VAR (%) | Cenário 1 | Cenário 2 | Cenário 3 |
|------------------------|-------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------|-----------------------|------------------------|-------------------------|
| LFS ITAU IPCA M D | 6.477.497,37 | 207.323,14 | 190.526,11 | 0,05% | 59.072,98 | (1.622,81) | (83.875,19) |
| LFS ITAU IPCA M D | 5.038.053,51 | 161.251,33 | 148.186,97 | 0,04% | 45.945,65 | (1.262,19) | (65.236,26) |
| LFS ITAU IPCA M D | 7.211.795,86 | 232.488,50 | 213.684,32 | 0,06% | 66.238,67 | (1.977,28) | (94.410,54) |
| LFSN BRADESCO IPCA | 11.007.625,99 | 648.310,45 | 592.540,05 | 0,17% | 243.872,36 | (54.392,93) | (449.391,61) |
| LFSN BRADESCO IPCA M D | 3.561.038,60 | 225.182,64 | 206.937,63 | 0,06% | 93.320,09 | (22.723,29) | (175.334,69) |
| NTNB | 1.716.337.847,56 | 177.549.463,27 | 174.938.613,78 | 49,94% | 171.928.153,47 | (50.816.441,10) | (283.336.699,95) |
| IBOVF85 | (187.200,97) | 831.104,75 | (811.930,97) | -0,23% | (499.549,72) | (1.956,44) | 184.239,27 |
| IBOVF880 | 87.748,02 | 562.519,25 | 549.544,60 | 0,16% | 430.991,41 | 1.261,45 | (87.615,71) |
| IBOVF91 | (53.761,85) | 446.382,73 | (436.087,93) | -0,12% | (487.969,44) | (976,42) | 53.773,87 |
| IBOVF94 | (11.270,96) | 155.100,74 | (151.524,22) | -0,04% | (427.844,23) | (328,61) | 11.279,19 |
| IBOVF950 | 8.755,24 | 116.440,77 | 113.755,70 | 0,03% | 335.385,06 | 247,12 | (8.761,59) |
| IBOVG100 | 23.995,24 | 194.950,96 | 190.456,04 | 0,05% | 310.007,13 | 529,13 | (23.961,11) |
| IBOVG90 | 263.413,25 | 1.156.761,76 | 1.130.081,91 | 0,32% | 819.055,13 | 3.306,63 | (255.302,68) |
| IBOVG94 | (2.502.737,15) | 14.897.527,15 | (14.553.991,43) | -4,15% | (14.099.695,92) | (41.326,67) | 2.481.329,81 |
| IBOVG95 | (158.331,87) | 1.040.832,37 | (1.016.832,06) | -0,29% | (1.106.482,94) | (2.864,61) | 157.552,37 |
| IBOVR68 | (3.243,74) | 22.161,06 | 21.650,37 | 0,01% | 3.116,52 | 38,12 | (65.301,79) |
| IBOVR70 | (3.694,84) | 26.674,89 | 26.060,17 | 0,01% | 3.578,43 | 46,22 | (81.854,13) |
| IBOVR73 | (8.576,35) | 55.397,72 | 54.121,15 | 0,02% | 8.214,28 | 94,57 | (125.132,58) |
| IBOVR750 | 53.309,18 | 360.538,36 | (352.230,03) | -0,10% | (51.475,80) | (619,53) | 804.826,42 |
| IBOVR800 | (56.182,09) | 342.684,88 | 334.788,34 | 0,10% | 53.913,58 | 580,32 | (523.036,13) |
| IBOVS70 | (1.092.301,51) | 4.554.206,55 | 4.449.314,95 | 1,27% | 940.659,12 | 9.740,23 | (6.311.535,59) |
| IBOVS770 | 2.636.043,93 | 10.646.799,10 | (10.401.589,50) | -2,97% | (2.275.611,04) | (22.658,31) | 12.534.497,69 |
| IDIFP83 | 22.321,53 | 23.468,06 | (13.416,37) | 0,00% | 5.584,63 | 74.777,20 | 169.667,59 |
| IDIFP8M | (23.292,57) | 24.690,26 | 14.115,37 | 0,00% | (5.882,11) | (78.939,12) | (179.081,64) |
| IDIFPG1 | 1.054.374,93 | 1.088.904,70 | 625.605,69 | 0,18% | (160.258,37) | (768.482,24) | (863.798,87) |
| IDIFPG2 | (1.235.020,07) | 1.169.178,86 | (671.876,82) | -0,19% | 175.178,50 | 886.323,17 | 1.016.992,03 |
| IDIFPHG | 719.582,07 | 501.995,57 | 288.753,42 | 0,08% | (79.092,63) | (474.496,63) | (587.164,19) |
| IDIFPHH | (791.678,17) | 517.895,17 | (297.971,38) | -0,09% | 82.109,34 | 508.209,85 | 639.721,40 |
| IDINFT | 2.007.665,73 | 629.035,11 | 425.815,54 | 0,12% | (1.517.940,67) | (1.717.565,11) | (1.814.946,13) |
| IDINNG5 | 508.554,07 | 672.100,38 | 455.492,35 | 0,13% | (515.806,80) | (516.727,39) | (517.984,19) |
| IDINNG6 | (1.891.894,44) | 1.027.612,28 | (696.074,14) | -0,20% | 1.708.744,32 | 1.811.274,00 | 1.852.857,78 |
| IDINNG7 | 1.091.490,12 | 613.874,22 | 415.832,60 | 0,12% | (1.034.138,45) | (1.076.649,93) | (1.090.830,42) |
| IDINNG8 | 1.443.915,46 | 676.877,90 | 458.433,68 | 0,13% | (1.300.280,69) | (1.386.421,49) | (1.419.233,63) |
| IDINNG9 | (2.371.685,62) | 956.545,43 | (647.739,40) | -0,18% | 2.023.023,20 | 2.203.837,46 | 2.279.980,10 |
| IDINNGB | (1.003.540,87) | 354.488,35 | (240.006,93) | -0,07% | 807.570,13 | 897.317,84 | 938.261,64 |
| CHEMICAL IX FIDC CON | 1.396.045,56 | 6.228,93 | 3.088,02 | 0,00% | 4.999,66 | 2.472,52 | (977,56) |
| FIDC CELG DIST SN B | 8.953.046,77 | 113.727,68 | (13.878,87) | 0,00% | (197.514,96) | (269.711,92) | (367.857,82) |
| FIDC VERDECARD SN3 | 6.900.000,00 | 30.786,67 | 15.262,64 | 0,00% | 24.710,99 | 12.220,52 | (4.831,61) |
| FII C JARDIM | 1.781.752,00 | 291.461,99 | 151.533,85 | 0,04% | (12.982,09) | (84.577,72) | (178.244,40) |
| SANEAGOIFR IV 1 FIDC | 7.523.578,75 | 58.994,18 | 27.532,23 | 0,01% | (132.622,07) | (164.464,32) | (207.915,88) |
| VINC RENDA IMOB FII | 3.001.261,78 | 13.391,14 | 6.638,72 | 0,00% | 10.748,43 | 5.315,50 | (2.101,58) |
| XP INDUSTRIAL FII | 131.013,19 | 584,56 | 289,80 | 0,00% | 469,20 | 232,04 | (91,74) |
| Total | 3.610.133.210,99 | 470.146.759,53 | 350.292.294,23 | 100,00% | 267.459.979,75 | (36.972.342,66) | (365.447.650,17) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Segmento de Investimento

Data: 29/05/2020

EMBRAER PREV RENDA FIXA

Dados Gerais

| | | | |
|------|------------------|------------|-----------|
| PL: | 2.249.035.435,41 | VAR / PL: | 8,473% |
| VAR: | 190.550.238,27 | ETL / PL: | 10,6249% |
| ETL: | 238.957.768,20 | VAR / CDI: | 74681,60% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|------------------|----------|---------------|------------|------------------|
| ALTA 1: | (314.788.077,25) | BAIXA 1: | 85.032.617,75 | Cenário 1: | 178.888.670,69 |
| | | | | Cenário 2: | (51.383.952,16) |
| | | | | Cenário 3: | (294.128.341,92) |

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 | 34.000,00 | 157,04 | 76,87 | 0,00% | 104,37 | 58,40 | (4,40) |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | (238.905,06) | 1.103,46 | (540,12) | 0,00% | (733,38) | (410,34) | 30,92 |
| CDB31957FN7 | 236.732,80 | 1.093,43 | 535,21 | 0,00% | 726,72 | 406,61 | (30,64) |
| SULM15 | 1.854,71 | 8,57 | 4,19 | 0,00% | 5,69 | 3,19 | (0,24) |
| DI1F22 | 3.808.560,13 | 52.803,60 | 38.617,83 | 0,02% | 42.441,88 | (9.433,04) | (47.871,17) |
| COMPROMISSADA | 252.347.057,33 | 1.169.909,43 | 572.209,45 | 0,30% | 779.282,65 | 431.003,93 | (39.881,11) |
| DE252 ALUPAR CDI - ALUP17 | 2.667.662,20 | 13.115,70 | 9.036,38 | 0,00% | 10.573,48 | 3.363,44 | (3.919,89) |
| DE252 AMPLA EN CDI - AMPL19 | 1.246.058,80 | 5.733,32 | 2.625,09 | 0,00% | 3.471,13 | 2.325,41 | 390,62 |
| DE252 DASA CDI - DASAB0 | 2.088.636,74 | 12.845,60 | (4.564,86) | 0,00% | (712,17) | 7.199,99 | 10.272,88 |
| DE252 GETI CDI - TIET19 | 2.436.183,65 | 52.759,31 | 46.939,82 | 0,02% | 48.436,71 | (15.368,52) | (55.184,34) |
| DE252 GUAR CDI - GUAR11 | 1.085.558,45 | 5.093,01 | 2.215,02 | 0,00% | 2.963,40 | 2.057,34 | 433,52 |
| DE252 LAME CDI - LAMEA1 | 729.676,49 | 3.320,79 | 1.870,23 | 0,00% | 2.483,85 | 1.126,51 | (470,54) |
| DE252 LOCALIZA CDI - LORTA1 | 615.166,36 | 3.139,23 | 831,68 | 0,00% | 1.334,84 | 1.344,70 | 775,91 |
| DE252 MOV_PART CDI - MOV133 | 1.376.166,53 | 6.336,49 | 3.090,59 | 0,00% | 4.224,52 | 2.363,68 | (178,12) |
| DE252 NATURA CDI - NATU27 | 639.696,81 | 2.945,14 | 1.449,75 | 0,00% | 1.987,77 | 1.086,18 | (120,15) |
| DE252 NCF PART CDI - NCFP13 | 917.888,25 | 4.230,61 | 1.940,04 | 0,00% | 2.578,05 | 1.701,96 | 254,98 |
| DE252 SABEREDU CDI - SSED11 | 806.487,05 | 3.713,83 | 1.816,83 | 0,00% | 2.486,30 | 1.379,69 | (120,80) |
| DE252 TELEF BR CDI - VIVT15 | 2.255.334,60 | 11.164,40 | 3.444,51 | 0,00% | 5.344,23 | 4.695,22 | 2.146,86 |
| DE252 USIMNAS CDI - USIM27 | 5.501.643,63 | 28.379,52 | 21.288,88 | 0,01% | 23.884,24 | 5.873,57 | (11.204,69) |
| LF selic | 8.890.532,37 | 63.111,34 | (27.115,88) | -0,01% | (7.833,67) | 33.658,88 | 53.673,56 |
| LFT | 127.434.566,95 | 596.567,76 | 289.821,85 | 0,15% | 391.195,24 | 218.879,58 | (16.493,70) |
| CMTR33 | 9.632.485,53 | 183.579,78 | 156.452,95 | 0,08% | 51.917,61 | 8.369,85 | (50.918,70) |
| CPTE11 | 4.969.999,72 | 127.277,98 | 116.125,08 | 0,06% | 37.963,56 | (97,05) | (48.364,34) |
| CRI HABITASE IPCA | 5.016.248,06 | 179.434,41 | 166.088,37 | 0,09% | 65.512,58 | (10.868,93) | (101.351,27) |
| CRI HABITASE IPCA | 25.796.701,28 | 1.494.299,98 | 1.382.171,01 | 0,73% | 516.812,71 | (114.046,11) | (951.523,05) |
| CRI HABITASE IPCA | 10.455.076,80 | 324.612,48 | 300.460,22 | 0,16% | 112.901,09 | (12.595,19) | (167.731,63) |
| CRI RB CAPIT IPCA M D | 10.214.434,05 | 410.473,28 | 383.314,64 | 0,20% | 174.553,12 | (35.191,81) | (288.445,17) |
| DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23 | 13.571.731,35 | 627.684,77 | 583.109,07 | 0,31% | 238.780,67 | (50.035,44) | (405.743,57) |
| DE252 CART - IPCA CART22 | 23.211.014,41 | 904.138,82 | 836.509,34 | 0,44% | 284.242,31 | (37.452,88) | (468.010,94) |
| DE252 CCR IPCA - CCRDD1 | 5.167.096,60 | 226.218,92 | 208.981,86 | 0,11% | 77.739,04 | (14.147,24) | (129.002,70) |
| DE252 CEMIG - IPCA CMDT23 | 8.936.870,85 | 130.869,58 | 103.700,55 | 0,05% | 40.629,96 | 10.520,17 | (30.525,64) |
| DE252 CEMIG - IPCA CMDT33 | 2.412.025,75 | 94.141,20 | 87.087,41 | 0,05% | 29.329,54 | (3.816,46) | (48.180,61) |
| DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17 | 40.741.759,14 | 2.323.667,58 | 2.158.365,37 | 1,13% | 1.399.282,07 | 36.872,89 | (2.525.513,50) |
| DE252 CSMG IPCA - CSMGC3 | 13.986.813,96 | 582.104,23 | 539.825,79 | 0,28% | 203.709,82 | (36.043,36) | (333.318,08) |
| DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24 | 20.624.935,05 | 540.859,34 | 492.197,38 | 0,26% | 155.347,95 | 1.847,92 | (205.967,83) |
| DE252 DUKE GEP IPCA GEPA25 | 1.753.919,91 | 26.112,84 | 20.561,00 | 0,01% | 7.876,29 | 2.099,81 | (5.781,84) |
| DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17 | 11.820.713,78 | 534.840,39 | 496.562,68 | 0,26% | 201.665,69 | (41.458,88) | (340.230,87) |
| DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36 | 3.444.731,07 | 150.812,62 | 139.321,24 | 0,07% | 51.826,02 | (9.431,49) | (86.001,80) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT11 | 4.197.726,69 | 92.256,73 | 81.710,74 | 0,04% | 25.886,42 | 2.459,30 | (29.370,03) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT21 | 1.215.771,81 | 22.305,01 | 18.849,55 | 0,01% | 6.358,12 | 1.127,53 | (5.995,39) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT31 | 2.553.463,67 | 38.173,45 | 31.478,31 | 0,02% | 13.365,54 | 2.367,05 | (12.572,65) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT41 | 4.282.238,19 | 86.044,33 | 72.034,82 | 0,04% | 24.851,96 | 3.076,57 | (26.522,14) |
| DE252 IGUATEMI - IPCA IGTA24 | 6.189.568,18 | 90.638,68 | 71.821,74 | 0,04% | 28.139,82 | 7.286,14 | (21.141,69) |
| DE252 IMED - IPCA SULM23 | 2.181.137,59 | 43.013,22 | 37.136,59 | 0,02% | 12.439,40 | 1.583,12 | (12.711,26) |
| DE252 JSLG - IPCA JSML36 | 606.258,39 | 4.038,91 | 1.752,58 | 0,00% | 2.725,48 | 726,86 | (1.974,86) |
| DE252 LAME - IPCA LAME38 | 15.308.553,85 | 167.889,84 | 122.704,57 | 0,06% | 71.065,52 | 17.506,80 | (55.225,88) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Segmento de Investimento

Data: 29/05/2020

EMBRAER PREV RENDA FIXA

Dados Gerais

| | | | |
|------|------------------|------------|-----------|
| PL: | 2.249.035.435,41 | VAR / PL: | 8,473% |
| VAR: | 190.550.238,27 | ETL / PL: | 10,6249% |
| ETL: | 238.957.768,20 | VAR / CDI: | 74681,60% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|------------------|----------|---------------|------------|------------------|
| ALTA 1: | (314.788.077,25) | BAIXA 1: | 85.032.617,75 | Cenário 1: | 178.888.670,69 |
| | | | | Cenário 2: | (51.383.952,16) |
| | | | | Cenário 3: | (294.128.341,92) |

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 LAME IPCA - LAMEB1 | 9.032.620,37 | 363.961,60 | 335.701,07 | 0,18% | 107.880,23 | (13.636,07) | (176.913,68) |
| DE252 LIGHT IPCA - LIGHC2 | 13.655.666,35 | 90.974,37 | 39.475,95 | 0,02% | 61.390,10 | 16.372,26 | (44.482,66) |
| DE252 LIGHT IPCA - LSVE29 | 2.765.722,76 | 67.331,02 | 61.202,30 | 0,03% | 19.922,83 | 464,10 | (24.866,60) |
| DE252 PETR IPCA - PETR45 | 15.676.694,47 | 632.774,13 | 584.246,89 | 0,31% | 209.081,18 | (32.739,93) | (340.501,37) |
| DE252 RAIZEN E - IPCA RESA31 | 500.472,17 | 7.919,89 | 4.821,43 | 0,00% | 2.415,82 | 538,28 | (2.014,06) |
| DE252 RD COLIN - IPCA RDCO24 | 1.936.360,83 | 30.642,60 | 18.654,44 | 0,01% | 9.346,97 | 2.082,64 | (7.792,55) |
| DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34 | 12.746.437,79 | 263.102,93 | 241.901,41 | 0,13% | 104.441,67 | (6.612,23) | (125.065,16) |
| DE252 SABESP - IPCA SBESC7 | 13.906.850,72 | 323.550,17 | 289.890,71 | 0,15% | 90.571,14 | 6.395,92 | (107.877,70) |
| DE252 SANEPAR - IPCA SAPR23 | 768.194,01 | 10.912,26 | 8.558,42 | 0,00% | 3.596,39 | 866,65 | (2.849,49) |
| DE252 TRANS AL - IPCA TAAE23 | 3.404.802,96 | 53.880,46 | 32.801,05 | 0,02% | 16.435,27 | 3.662,02 | (13.702,05) |
| DE252 TRANS AL - IPCA TAAE33 | 14.708.702,00 | 516.486,76 | 476.040,28 | 0,25% | 157.392,80 | (15.533,46) | (247.676,72) |
| DEBI ELETROB IPCA - ELET42 | 12.241.398,58 | 757.164,97 | 702.381,54 | 0,37% | 440.809,77 | (119.620,61) | (791.657,39) |
| DEBI ENERGMIR IPCA - ENM21 | 1.117.455,77 | 53.427,01 | 49.831,20 | 0,03% | 23.190,63 | (5.338,46) | (39.818,48) |
| DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12 | 27.601.382,01 | 1.671.203,52 | 1.555.220,35 | 0,82% | 1.062.855,53 | (307.264,84) | (1.846.173,86) |
| DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21 | 1.879.662,32 | 86.409,70 | 80.597,04 | 0,04% | 36.849,94 | (8.198,91) | (62.773,22) |
| DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16 | 6.389.569,77 | 389.715,61 | 361.672,68 | 0,19% | 225.056,02 | (58.767,86) | (410.590,62) |
| ECCR32 | 9.802.386,99 | 206.640,50 | 175.778,01 | 0,09% | 59.331,89 | 6.151,91 | (66.095,45) |
| ENMA24 | 4.162.267,25 | 16.470,83 | 6.269,49 | 0,00% | 16.131,57 | 5.930,15 | (7.879,87) |
| LFS B.BRASIL IPCA | 10.518.791,07 | 52.263,92 | 17.947,15 | 0,01% | 32.499,50 | 17.990,40 | (1.826,26) |
| LFS ITAU IPCA | 4.545.845,74 | 138.891,34 | 125.379,84 | 0,07% | 35.182,52 | 53,89 | (47.612,83) |
| LFS ITAU IPCA M D | 720.605,57 | 23.714,60 | 21.586,05 | 0,01% | 6.063,69 | (168,46) | (8.614,96) |
| LFS ITAU IPCA M D | 3.603.027,86 | 118.573,01 | 107.930,24 | 0,06% | 30.318,45 | (842,29) | (43.074,79) |
| LFS ITAU IPCA M D | 8.647.266,86 | 284.575,24 | 259.032,58 | 0,14% | 72.764,27 | (2.021,50) | (103.379,49) |
| LFS ITAU IPCA M D | 6.485.450,14 | 213.431,43 | 194.274,43 | 0,10% | 54.573,21 | (1.516,12) | (77.534,62) |
| LFS ITAU IPCA M D | 5.044.239,00 | 166.002,22 | 151.102,34 | 0,08% | 42.445,83 | (1.179,21) | (60.304,70) |
| LFS ITAU IPCA M D | 7.220.787,17 | 239.275,53 | 217.927,20 | 0,11% | 61.230,03 | (1.858,61) | (87.353,71) |
| LFSN BRADESCO IPCA | 11.052.787,26 | 652.943,13 | 605.514,52 | 0,32% | 231.596,56 | (52.492,69) | (429.019,25) |
| LFSN BRADESCO IPCA M D | 3.579.014,57 | 226.261,71 | 211.217,31 | 0,11% | 88.884,16 | (21.940,22) | (167.844,42) |
| NTNB | 1.716.662.381,50 | 174.130.013,96 | 174.000.894,75 | 91,31% | 170.746.899,69 | (50.800.445,52) | (281.757.298,88) |
| CHEMICAL IX FIDC CON | 1.396.045,56 | 6.448,11 | 3.156,19 | 0,00% | 4.285,54 | 2.397,83 | (180,70) |
| FIDC CELG DIST SN B | 8.953.046,77 | 109.565,86 | (12.109,88) | -0,01% | (203.434,92) | (270.429,61) | (361.501,60) |
| FIDC VERDECARD SN3 | 6.900.000,00 | 31.870,00 | 15.599,55 | 0,01% | 21.181,42 | 11.851,33 | (893,09) |
| SANEAGOIFR M 1 FIDC | 7.523.578,75 | 67.707,19 | 31.825,48 | 0,02% | (131.687,15) | (162.078,46) | (203.545,71) |
| Total | 2.618.321.349,39 | 193.447.125,59 | 190.550.238,27 | 100,00% | 178.888.670,69 | (51.383.952,16) | (294.128.341,92) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Segmento de Investimento

Data: 29/05/2020

EMBRAER PREV RENDA VARIÁVEL

Dados Gerais

| | | | |
|------|----------------|------------|------------|
| PL: | 613.878.695,88 | VAR / PL: | 23,976% |
| VAR: | 147.182.036,55 | ETL / PL: | 30,0666% |
| ETL: | 184.572.274,97 | VAR / CDI: | 211335,59% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|---------------|----------|------------------|------------|-----------------|
| ALTA 1: | 40.203.589,41 | BAIXA 1: | (101.770.582,56) | Cenário 1: | 77.131.476,91 |
| | | | | Cenário 2: | 13.692.536,29 |
| | | | | Cenário 3: | (60.612.879,84) |

Parâmetros do Cálculo

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

| Produto | MTM | VAR Tot. | Comp. VAR | Comp. VAR (%) | Cenário 1 | Cenário 2 | Cenário 3 |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|----------------|----------------------|----------------------|------------------------|
| CAIXA | 10.000,00 | - | - | 0,00% | - | - | - |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | (2.050.148,37) | - | - | 0,00% | - | - | - |
| ABEV3 | 18.474.206,40 | 4.707.973,66 | 4.185.643,54 | 2,84% | 1.300.591,49 | (399.252,66) | (2.490.688,33) |
| B3SA3 | 36.077.558,65 | 9.525.037,75 | 8.730.862,94 | 5,93% | 5.655.579,15 | (621.585,16) | (7.709.006,87) |
| BBAS3 | 14.411.532,00 | 5.108.037,57 | 4.782.253,88 | 3,25% | 2.004.459,82 | (1.516.139,21) | (5.143.023,24) |
| BBDC4 | 43.699.420,10 | 10.550.827,71 | 9.716.095,43 | 6,60% | 2.530.551,69 | (6.345.767,23) | (15.796.025,80) |
| BEEF3 | 9.514.934,00 | 5.041.576,67 | 4.292.011,38 | 2,92% | 3.178.589,58 | 4.435.550,58 | 6.359.286,01 |
| BRDT3 | 12.124.892,00 | 5.323.949,30 | 5.156.740,32 | 3,50% | 4.458.336,12 | (420.694,76) | (4.858.717,91) |
| BRML3 | 8.840.772,00 | 3.038.792,78 | 2.872.828,57 | 1,95% | 123.595,09 | (1.037.077,28) | (2.385.533,83) |
| BRPR3 | 9.127.951,00 | 2.337.212,78 | 2.217.949,68 | 1,51% | 15.638,47 | (1.197.760,35) | (2.601.338,42) |
| BTOW3 | 27.477.296,10 | 13.207.573,10 | 11.667.218,02 | 7,93% | 13.627.316,51 | 10.648.903,19 | 6.920.506,59 |
| CCRO3 | 17.981.040,00 | 5.734.495,35 | 5.320.037,06 | 3,61% | 3.128.780,44 | (1.339.724,48) | (5.962.161,65) |
| CIEL3 | 6.116.595,00 | 1.383.556,38 | 829.478,48 | 0,56% | (124.519,51) | (1.544.738,06) | (2.958.987,12) |
| CPFE3 | 23.968.200,00 | 6.177.251,37 | 5.953.018,90 | 4,04% | 3.256.041,26 | 249.085,50 | (3.334.225,07) |
| CRFB3 | 5.665.336,00 | 644.083,99 | (231.600,07) | -0,16% | (333.603,04) | (745.003,98) | (1.256.923,55) |
| CSNA3 | 5.717.280,00 | 2.939.598,97 | 2.839.558,55 | 1,93% | 1.583.379,06 | 563.438,57 | (605.193,39) |
| ELET3 | 9.788.597,00 | 4.130.876,84 | 3.727.094,78 | 2,53% | 1.615.188,34 | (1.201.574,11) | (3.963.809,95) |
| ELET6 | 10.453.350,00 | 3.814.931,85 | 3.362.657,75 | 2,28% | 1.489.025,99 | (1.333.090,58) | (4.146.369,21) |
| ENG111 | 5.861.500,00 | 1.574.597,45 | 1.402.541,50 | 0,95% | 686.565,87 | (68.532,96) | (962.583,10) |
| HAPV3 | 23.908.262,30 | 7.332.223,30 | 6.281.133,37 | 4,27% | 5.693.699,68 | (1.105.396,25) | (7.951.761,84) |
| HYPE3 | 5.396.850,00 | 874.047,74 | 536.332,70 | 0,36% | 138.873,03 | (566.946,68) | (1.389.143,39) |
| ITUB4 | 34.878.804,48 | 7.485.344,61 | 6.913.249,83 | 4,70% | 2.772.428,72 | (2.495.159,86) | (8.529.038,64) |
| JBSS3 | 13.693.901,00 | 3.579.090,82 | 2.441.303,10 | 1,66% | 176.188,26 | 1.952.442,17 | 4.756.766,77 |
| KLBN11 | 4.878.225,00 | 1.730.841,66 | 1.453.736,86 | 0,99% | 482.032,02 | 1.466.012,28 | 3.111.248,50 |
| LAME4 | 8.983.500,00 | 3.584.794,71 | 3.339.020,50 | 2,27% | 2.923.864,98 | 1.829.899,42 | 494.163,04 |
| LREN3 | 13.006.770,00 | 3.743.874,33 | 3.491.037,25 | 2,37% | 1.265.130,39 | (932.136,06) | (3.400.895,36) |
| MDIA3 | 6.080.679,00 | 1.764.912,19 | 1.576.197,45 | 1,07% | 946.921,04 | 685.064,25 | 342.543,11 |
| MGLU3 | 12.747.735,00 | 5.917.716,16 | 5.728.516,04 | 3,89% | 5.006.175,64 | 3.346.346,25 | 1.323.936,92 |
| NTCO3 | 6.997.276,00 | 3.144.846,47 | 2.921.782,67 | 1,99% | 2.179.204,47 | 373.167,18 | (1.536.286,09) |
| PCAR3 | 3.545.774,00 | 567.224,93 | 344.737,06 | 0,23% | (121.683,37) | (299.999,70) | (529.013,59) |
| PETR3 | 12.101.788,00 | 6.915.725,65 | 6.793.197,74 | 4,62% | 3.534.324,91 | 1.127.184,96 | (1.577.417,36) |
| PETR4 | 28.115.148,06 | 14.832.574,97 | 14.532.593,57 | 9,87% | 6.972.296,45 | 2.284.985,35 | (3.130.490,87) |
| RADL3 | 8.317.440,00 | 974.081,70 | 748.533,09 | 0,51% | 248.554,83 | 133.247,87 | (21.996,95) |
| RAIL3 | 12.835.341,00 | 2.793.988,00 | 2.180.339,32 | 1,48% | 457.493,49 | 276.276,81 | 32.343,91 |
| RENT3 | 6.239.532,00 | 2.717.575,16 | 2.593.951,76 | 1,76% | 1.677.674,05 | (153.082,20) | (1.992.235,10) |
| SAPR11 | 9.518.355,00 | 2.645.274,86 | 2.371.442,36 | 1,61% | 1.541.858,15 | (7.151.516,83) | (3.076.883,33) |
| SUZB3 | 11.270.922,00 | 3.173.198,12 | 2.196.231,83 | 1,49% | 127.545,21 | 2.456.880,55 | 6.433.587,11 |
| TIMP3 | 7.128.708,00 | 1.195.979,59 | 1.023.213,39 | 0,70% | 667.924,50 | (377.631,44) | (1.584.771,35) |
| TOTS3 | 17.712.888,00 | 6.096.099,43 | 5.744.719,92 | 3,90% | 4.436.449,24 | (289.966,08) | (5.166.829,24) |
| VALE3 | 62.258.835,00 | 16.270.434,87 | 14.512.603,21 | 9,86% | 6.156.005,79 | 7.935.961,72 | 10.446.433,01 |
| VNT4 | 8.640.762,00 | 903.390,60 | 508.494,95 | 0,35% | 127.918,27 | (676.802,81) | (1.659.498,91) |
| WEGE3 | 6.224.304,00 | 1.447.231,12 | 947.073,32 | 0,64% | 872.730,56 | (307.402,45) | (1.610.748,00) |
| YDUQ3 | 3.315.072,00 | 1.552.088,25 | 1.416.801,94 | 0,96% | 841.563,86 | (329.125,02) | (1.416.021,63) |
| COMPROMISSADA | 23.671.067,36 | 479,78 | 180,41 | 0,00% | 434,76 | (227,32) | (677,15) |
| IBOVG94 | (2.137.760,00) | 14.088.082,50 | (14.067.760,38) | -9,56% | (14.663.761,36) | (35.429,71) | 2.128.191,65 |
| IBOV570 | (1.487.999,69) | 5.347.605,72 | 5.339.901,15 | 3,63% | 1.225.086,00 | 13.927,36 | (6.639.985,20) |
| IBOV570 | 3.357.920,00 | 11.527.526,26 | (11.510.918,56) | -7,82% | (2.750.972,99) | (30.074,45) | 12.426.395,00 |
| Total | 614.460.411,38 | 217.446.627,03 | 147.182.036,55 | 100,00% | 77.131.476,91 | 13.692.536,29 | (60.612.879,84) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 29/05/2020

FI RF EMB | CNPJ - 12.636.535/0001-32

Dados Gerais

| | | | |
|------|----------------|------------|-----------|
| PL: | 808.285.371,17 | VAR / PL: | 11,176% |
| VAR: | 90.334.972,80 | ETL / PL: | 14,0153% |
| ETL: | 113.283.739,17 | VAR / CDI: | 98512,56% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|------------------|----------|---------------|------------|------------------|
| ALTA 1: | (148.108.817,48) | BAIXA 1: | 42.311.311,69 | Cenário 1: | 86.534.956,80 |
| | | | | Cenário 2: | (25.320.482,30) |
| | | | | Cenário 3: | (143.444.766,11) |

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 | 41,57 | 19,77 | 0,00% | 27,63 | 15,46 | (1,16) |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | (39.655,60) | 183,16 | (87,12) | 0,00% | (121,73) | (68,11) | 5,13 |
| COMPROMISSADA | 88.400.064,92 | 409.832,68 | 194.795,34 | 0,22% | 272.991,64 | 150.985,61 | (13.970,81) |
| DE252 CEMIG - IPCA CMDT23 | 8.936.870,85 | 130.869,58 | 102.367,01 | 0,11% | 40.629,96 | 10.520,17 | (30.525,64) |
| DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17 | 15.714.678,29 | 896.271,77 | 830.440,06 | 0,92% | 539.723,08 | 14.222,40 | (974.126,62) |
| DE252 JSLG - IPCA JSML36 | 245.765,73 | 1.637,30 | 687,51 | 0,00% | 1.104,86 | 294,66 | (800,57) |
| DE252 LAME - IPCA LAME38 | 2.238.759,39 | 24.552,61 | 17.652,31 | 0,02% | 10.392,79 | 2.560,24 | (8.076,36) |
| DE252 RAIZEN E - IPCA RESA31 | 500.472,17 | 7.919,89 | 4.720,59 | 0,01% | 2.415,82 | 538,28 | (2.014,06) |
| DE252 RD COLIN - IPCA RDICO24 | 1.133.964,73 | 17.944,81 | 10.695,87 | 0,01% | 5.473,74 | 1.219,63 | (4.563,46) |
| DEBI ELETROB IPCA - ELET42 | 12.241.398,58 | 757.164,97 | 700.486,56 | 0,78% | 440.809,77 | (119.620,61) | (791.657,39) |
| DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12 | 11.924.989,52 | 722.032,12 | 670.615,72 | 0,74% | 459.199,51 | (132.751,69) | (797.626,87) |
| DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16 | 6.389.569,77 | 389.715,61 | 360.660,75 | 0,40% | 225.056,02 | (58.767,86) | (410.590,62) |
| LFS ITAU IPCA | 4.545.845,74 | 138.891,34 | 124.352,08 | 0,14% | 35.182,52 | 53,89 | (47.612,83) |
| LFS ITAU IPCA M D | 720.605,57 | 23.714,60 | 21.425,42 | 0,02% | 6.063,69 | (168,46) | (8.614,96) |
| LFS ITAU IPCA M D | 3.603.027,86 | 118.573,01 | 107.127,11 | 0,12% | 30.318,45 | (842,29) | (43.074,79) |
| LFS ITAU IPCA M D | 8.647.266,85 | 284.575,24 | 257.105,07 | 0,28% | 72.764,27 | (2.021,50) | (103.379,49) |
| LFS ITAU IPCA M D | 6.485.450,14 | 213.431,43 | 192.828,80 | 0,21% | 54.573,21 | (1.516,12) | (77.534,62) |
| LFS ITAU IPCA M D | 5.044.239,00 | 166.002,22 | 149.977,96 | 0,17% | 42.445,83 | (1.179,21) | (60.304,70) |
| NTNB | 837.480.218,14 | 86.601.916,44 | 86.589.102,00 | 95,85% | 84.295.905,75 | (25.183.956,79) | (140.070.296,30) |
| Total | 1.014.222.531,65 | 90.905.270,36 | 90.334.972,80 | 100,00% | 86.534.956,80 | (25.320.482,30) | (143.444.766,11) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 29/05/2020

FI RF EMB I A - CNPJ 20.725.946/0001-22

Dados Gerais

| | | | |
|------|----------------|------------|---------|
| PL: | 173.865.740,43 | VAR / PL: | 0,023% |
| VAR: | 39.471,88 | ETL / PL: | 0,0285% |
| ETL: | 49.499,34 | VAR / CDI: | 200,11% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|----------------|----------|--------------|------------|-------------|
| ALTA 1: | (1.010.379,13) | BAIXA 1: | 1.252.709,26 | Cenário 1: | 22.787,26 |
| | | | | Cenário 2: | (11.811,80) |
| | | | | Cenário 3: | (34.979,07) |

Parâmetros do Cálculo

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

| Produto | MTM | VAR Tot. | Comp. VAR | Comp. VAR (%) | Cenário 1 | Cenário 2 | Cenário 3 |
|-----------------------------|-----------------------|------------------|------------------|----------------|------------------|--------------------|--------------------|
| CAIXA | 9.000,00 | - | - | 0,00% | - | - | - |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | (15.512,19) | - | - | 0,00% | - | - | - |
| SULM15 | 1.854,71 | - | - | 0,00% | - | - | - |
| DI1F22 | 3.808.560,13 | 52.899,43 | 51.482,10 | 130,43% | 30.750,47 | (15.974,56) | (47.378,22) |
| COMPROMISSADA | 35.980.685,80 | 729,28 | (81,30) | -0,21% | 660,85 | (345,53) | (1.029,29) |
| DE252 AMPLA EN CDI - AMPL19 | 1.246.058,80 | 376,79 | (321,61) | -0,81% | (353,99) | 185,20 | 551,90 |
| DE252 GUAR CDI - GUAR11 | 1.085.558,45 | 487,72 | (467,52) | -1,18% | (369,02) | 192,80 | 574,03 |
| DE252 LAME CDI - LAMEA1 | 729.676,49 | 392,33 | 380,94 | 0,97% | 243,91 | (126,77) | (376,10) |
| DE252 LOCALIZA CDI - LORTA1 | 615.166,35 | 957,50 | (930,93) | -2,36% | (553,58) | 288,10 | 855,53 |
| DE252 MOV_PART CDI - MOV133 | 1.376.166,53 | 29,94 | (2,62) | -0,01% | 0,00 | - | 0,01 |
| DE252 NATURA CDI - NATU27 | 639.696,81 | 27,71 | 23,40 | 0,06% | 24,05 | (12,55) | (37,35) |
| DE252 NCF PART CDI - NCFP13 | 917.888,25 | 262,60 | (229,82) | -0,58% | (239,65) | 125,41 | 373,79 |
| DE252 SABEREDU CDI - SSED11 | 806.487,05 | 18,47 | 8,55 | 0,02% | 10,57 | (5,52) | (16,41) |
| DE252 TELEF BR CDI - VMT15 | 2.255.334,60 | 2.746,92 | (2.660,04) | -6,74% | (1.579,13) | 821,50 | 2.438,78 |
| LF selic | 3.896.662,48 | 9.197,71 | (7.705,40) | -19,52% | (5.807,44) | 3.040,12 | 9.063,63 |
| LFT | 123.185.818,57 | 9.541,86 | (23,88) | -0,06% | 0,22 | - | 0,64 |
| CHEMICAL IX FIDC CON | 1.396.045,56 | - | - | 0,00% | - | - | - |
| Total | 177.935.148,39 | 77.668,24 | 39.471,88 | 100,00% | 22.787,26 | (11.811,80) | (34.979,07) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 29/05/2020

FIM EMB II A - CNPJ 20.725.957/0001-02

Dados Gerais

| | | | |
|------|----------------|------------|-----------|
| PL: | 138.702.438,74 | VAR / PL: | 1,286% |
| VAR: | 1.784.083,27 | ETL / PL: | 1,6130% |
| ETL: | 2.237.313,17 | VAR / CDI: | 11337,87% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|----------------|----------|--------------|------------|----------------|
| ALTA 1: | (4.772.390,78) | BAIXA 1: | 1.007.551,15 | Cenário 1: | 897.227,06 |
| | | | | Cenário 2: | (453.673,56) |
| | | | | Cenário 3: | (1.375.557,82) |

Parâmetros do Cálculo

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

| Produto | MTM | VAR Tot. | Comp. VAR | Comp. VAR (%) | Cenário 1 | Cenário 2 | Cenário 3 |
|-----------------------------|-----------------------|----------------------|---------------------|----------------|-------------------|---------------------|-----------------------|
| CAIXA | 9.000,00 | - | - | 0,00% | - | - | - |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | (28.744,94) | - | - | 0,00% | - | - | - |
| DH1V20 | (496.065,00) | 565,86 | (283,98) | -0,02% | (637,47) | 333,22 | 992,42 |
| DH1F23 | (124.273.162,74) | 3.899.720,16 | (3.761.182,80) | -210,82% | (2.175.292,10) | 1.120.649,01 | 3.305.060,84 |
| DH1N23 | 270.554.676,99 | 10.961.399,67 | 10.695.908,41 | 599,52% | 6.318.446,73 | (3.239.015,40) | (9.521.023,24) |
| DH1F24 | (110.347.636,70) | 5.372.575,68 | (5.177.906,51) | -290,23% | (3.285.533,43) | 1.675.366,10 | 4.907.344,77 |
| COMPROMISSADA | 60.766.825,93 | 1.231,66 | 69,40 | 0,00% | 1.116,09 | (583,56) | (1.738,34) |
| DE252 ENERSUL CDI - ESUL18 | 950.934,92 | 1.847,11 | (1.742,58) | -0,10% | (1.022,61) | 534,45 | 1.591,58 |
| DE252 GUAR CDI - GUAR11 | 251.286,68 | 112,90 | (85,24) | 0,00% | (85,42) | 44,63 | 132,88 |
| DE252 LOCALIZA CDI - LORTA1 | 543.396,95 | 845,80 | (721,06) | -0,04% | (488,99) | 254,49 | 755,72 |
| DE252 NATURA CDI - NATU27 | 1.134.945,96 | 49,15 | 22,91 | 0,00% | 42,66 | (22,27) | (66,27) |
| DE252 NCF PART CDI - NCFP13 | 2.141.739,25 | 612,73 | (434,67) | -0,02% | (559,19) | 292,62 | 872,17 |
| DE252 SABEREDU CDI - SSED11 | 255.217,42 | 5,84 | (0,01) | 0,00% | 3,34 | (1,75) | (5,19) |
| DE252 TELEF BR CDI - VMT15 | 3.047.749,46 | 3.712,05 | (3.210,80) | -0,18% | (2.133,96) | 1.110,13 | 3.295,65 |
| LF selic | 3.560.471,18 | 6.389,92 | (6.188,68) | -0,35% | (3.998,73) | 2.093,70 | 6.242,86 |
| LFSN B VOTORA CDI | 2.211.047,27 | 4.110,81 | (3.359,55) | -0,19% | (2.502,89) | 1.309,71 | 3.903,60 |
| LFT | 64.389.148,60 | 5.817,54 | (283,75) | -0,02% | 0,11 | (0,00) | 0,33 |
| NTNB | 400.719,52 | 48.150,01 | 43.482,19 | 2,44% | 49.872,91 | (16.038,64) | (82.917,59) |
| Total | 175.071.550,74 | 20.307.146,90 | 1.784.083,27 | 100,00% | 897.227,06 | (453.673,56) | (1.375.557,82) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 29/05/2020

FIM EMB III A IMOBILIÁRIO - CNPJ 32.711.990/0001-62

Dados Gerais

| | | | |
|------|---------------|------------|-----------|
| PL: | 28.460.084,14 | VAR / PL: | 8,298% |
| VAR: | 2.361.499,78 | ETL / PL: | 10,4055% |
| ETL: | 2.961.417,00 | VAR / CDI: | 73139,52% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|------------|----------|--------|------------|----------------|
| ALTA 1: | 768.737,64 | BAIXA 1: | (2,21) | Cenário 1: | 1.613.722,22 |
| | | | | Cenário 2: | 48.125,57 |
| | | | | Cenário 3: | (1.991.966,71) |

Parâmetros do Cálculo

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

| Produto | MTM | VAR Tot. | Comp. VAR | Comp. VAR (%) | Cenário 1 | Cenário 2 | Cenário 3 |
|--------------------------|----------------------|---------------------|---------------------|----------------|---------------------|------------------|-----------------------|
| CAIXA | 1.000,00 | 165,85 | 162,31 | 0,01% | 49,36 | 11,17 | (38,85) |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | 195.083,88 | 32.354,64 | 31.664,07 | 1,34% | 9.630,08 | 2.178,57 | (7.578,66) |
| BMLC11B | 471.565,00 | 78.208,99 | 76.539,72 | 3,24% | 23.278,23 | 5.266,14 | (18.319,46) |
| BPML11 | 768.240,00 | 126.235,65 | 123.254,26 | 5,22% | 37.923,23 | 8.579,21 | (29.844,75) |
| BTLG11 | 1.904.515,20 | 315.771,39 | 309.014,04 | 13,09% | 94.014,08 | 21.268,40 | (73.987,01) |
| CEOC11 | 346.901,40 | 57.533,55 | 56.305,57 | 2,38% | 17.124,37 | 3.873,97 | (13.476,50) |
| CNES11 | 1.296.519,18 | 215.027,53 | 210.438,05 | 8,91% | 64.001,10 | 14.478,69 | (50.367,45) |
| FIGS11 | 746.771,25 | 64.236,06 | (54.236,09) | -2,30% | 74.541,09 | (12.535,14) | (122.978,23) |
| FVPQ11 | 1.589.327,25 | 263.589,71 | 257.963,74 | 10,92% | 78.455,21 | 17.748,59 | (61.742,52) |
| GRLV11 | 834.198,05 | 73.418,19 | 26.586,70 | 1,13% | 99.828,91 | (5.500,83) | (138.042,82) |
| HSML11 | 4.588.624,35 | 429.444,91 | (270.952,96) | -11,47% | 208.077,18 | (38.292,10) | (363.280,74) |
| JRDM11 | 774.554,50 | 83.361,12 | (33.312,99) | -1,41% | 73.136,48 | 22.171,41 | (44.907,00) |
| LVB11 | 48.760,00 | 8.086,84 | 7.914,24 | 0,34% | 2.406,98 | 544,52 | (1.894,24) |
| MALL11 | 2.758.693,50 | 317.312,52 | (253.492,21) | -10,73% | 216.604,55 | (35.781,53) | (362.640,34) |
| MAXR11 | 617.907,42 | 102.479,86 | 100.292,57 | 4,25% | 30.502,25 | 6.900,39 | (24.004,60) |
| RBGS11 | 760.117,80 | 126.065,44 | 123.374,73 | 5,22% | 37.522,29 | 8.488,51 | (29.529,22) |
| RCRB11 | 2.192.022,00 | 363.546,56 | 355.787,13 | 15,07% | 108.206,50 | 24.479,10 | (85.156,13) |
| RNGO11 | 450.213,40 | 74.667,83 | 73.074,15 | 3,09% | 22.224,24 | 5.027,69 | (17.489,98) |
| SDIL11 | 399.744,80 | 39.909,22 | (6.085,42) | -0,26% | 17.289,91 | (7.655,16) | (40.506,37) |
| TEPP11 | 1.235.482,36 | 204.904,59 | 200.531,17 | 8,49% | 60.988,09 | 13.797,07 | (47.996,28) |
| TRXF11 | 1.164.336,80 | 192.977,90 | 188.830,20 | 8,00% | 57.476,07 | 13.002,57 | (45.232,40) |
| COMPROMISSADA | 1.158.923,35 | 192.201,77 | 188.096,83 | 7,97% | 57.230,14 | 12.930,98 | (45.055,27) |
| FII C JARDIM | 1.781.752,00 | 262.591,08 | 141.350,35 | 5,99% | 68.590,94 | (67.835,90) | (246.214,63) |
| VINC RENDA IMOB FII | 3.001.261,78 | 497.758,87 | 487.134,86 | 20,63% | 148.153,64 | 33.516,17 | (116.593,65) |
| XP INDUSTRIAL FII | 131.013,19 | 21.728,52 | 21.264,75 | 0,90% | 6.467,31 | 1.463,07 | (5.089,63) |
| Total | 29.217.528,47 | 4.143.578,60 | 2.361.499,78 | 100,00% | 1.613.722,22 | 48.125,57 | (1.991.966,71) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 29/05/2020

FI RF EMB IV CRED PRIV - CNPJ 18.033.297/0001-57

Dados Gerais

| | | | |
|------|----------------|------------|-----------|
| PL: | 158.163.008,31 | VAR / PL: | 2,246% |
| VAR: | 3.552.213,97 | ETL / PL: | 2,8165% |
| ETL: | 4.454.621,15 | VAR / CDI: | 19796,78% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|----------------|----------|--------------|------------|----------------|
| ALTA 1: | (5.922.562,44) | BAIXA 1: | (369.944,08) | Cenário 1: | 1.435.220,09 |
| | | | | Cenário 2: | 3.876,82 |
| | | | | Cenário 3: | (1.998.268,06) |

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 | 46,19 | 28,94 | 0,00% | 30,70 | 17,18 | (1,29) |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | (46.163,43) | 213,22 | (133,60) | 0,00% | (141,71) | (79,29) | 5,98 |
| CDB31957FN7 | 236.732,80 | 1.093,43 | 685,14 | 0,02% | 726,72 | 406,61 | (30,64) |
| COMPROMISSADA | 14.914.648,81 | 69.145,99 | 43.276,34 | 1,22% | 46.058,50 | 25.473,93 | (2.357,12) |
| DE252 ALUPAR CDI - ALUP17 | 2.667.662,20 | 13.115,70 | 10.593,15 | 0,30% | 10.573,48 | 3.363,44 | (3.919,89) |
| DE252 DASA CDI - DASAB0 | 2.088.636,74 | 12.845,60 | (3.039,90) | -0,09% | (712,17) | 7.199,99 | 10.272,88 |
| DE252 GETI CDI - TIET19 | 2.436.183,65 | 52.759,31 | 49.722,95 | 1,40% | 48.436,71 | (15.368,52) | (55.184,34) |
| DE252 USIMINAS CDI - USIM27 | 5.501.643,63 | 28.379,52 | 24.378,22 | 0,69% | 23.884,24 | 5.873,57 | (11.204,69) |
| LF selic | 4.993.869,89 | 47.938,93 | (23.849,71) | -0,67% | (13.988,10) | 23.925,91 | 45.114,30 |
| LFT | 4.248.748,32 | 19.994,71 | 12.465,24 | 0,35% | 13.042,69 | 7.297,58 | (549,91) |
| CMTR33 | 5.716.386,17 | 108.945,18 | 104.710,50 | 2,95% | 30.810,44 | 4.967,08 | (30.217,64) |
| DE252 CCR IPCA - CCRDD1 | 5.167.096,60 | 226.218,92 | 221.561,78 | 6,24% | 77.739,04 | (14.147,24) | (129.002,70) |
| DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17 | 6.984.301,46 | 398.343,01 | 382.484,98 | 10,77% | 239.876,92 | 6.321,07 | (432.945,16) |
| DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24 | 16.499.948,04 | 432.687,48 | 431.298,56 | 12,14% | 124.278,36 | 1.478,33 | (164.774,26) |
| DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36 | 3.444.731,07 | 150.812,62 | 147.707,85 | 4,16% | 51.826,02 | (9.431,49) | (86.001,80) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT31 | 576.402,63 | 8.617,03 | 8.207,80 | 0,23% | 3.017,05 | 534,32 | (2.838,07) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT41 | 731.580,94 | 14.699,88 | 14.031,27 | 0,40% | 4.245,73 | 525,60 | (4.531,06) |
| DE252 IGUAATEMI - IPCA IGTA24 | 6.189.568,18 | 90.638,68 | 81.609,35 | 2,30% | 28.139,82 | 7.286,14 | (21.141,69) |
| DE252 IMED - IPCA SULM23 | 2.181.137,59 | 43.013,22 | 41.800,79 | 1,18% | 12.439,40 | 1.583,12 | (12.711,26) |
| DE252 LAME - IPCA LAME38 | 11.349.266,35 | 124.468,10 | 109.621,80 | 3,09% | 52.685,68 | 12.978,98 | (40.942,68) |
| DE252 LIGHT IPCA - LSVE29 | 2.765.722,76 | 67.331,02 | 67.051,94 | 1,89% | 19.922,83 | 464,10 | (24.866,60) |
| DE252 SANEPAR - IPCA SAPR23 | 768.194,01 | 10.912,26 | 9.486,36 | 0,27% | 3.596,39 | 866,65 | (2.849,49) |
| DE252 TRANS AL - IPCA TAEE23 | 1.839.855,96 | 29.115,42 | 21.825,24 | 0,61% | 8.881,14 | 1.978,85 | (7.404,19) |
| DE252 TRANS AL - IPCA TAEE33 | 9.357.921,15 | 328.597,48 | 327.290,98 | 9,21% | 100.135,92 | (9.882,64) | (157.576,05) |
| DEBI ENERGMIR IPCA - ENM21 | 1.117.455,77 | 53.427,01 | 52.187,37 | 1,47% | 23.190,63 | (5.338,46) | (39.818,48) |
| DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21 | 1.879.662,32 | 86.409,70 | 84.586,80 | 2,38% | 36.849,94 | (8.198,91) | (62.773,22) |
| ECCR32 | 9.802.386,99 | 206.640,50 | 199.325,94 | 5,61% | 59.331,89 | 6.151,91 | (66.095,45) |
| ENMA24 | 4.162.267,25 | 16.470,83 | 9.893,53 | 0,28% | 16.131,57 | 5.930,15 | (7.879,87) |
| LFS B.BRASIL IPCA | 10.518.791,07 | 52.263,92 | 26.100,48 | 0,73% | 32.499,50 | 17.990,40 | (1.826,26) |
| LFS ITAU IPCA M D | 7.220.787,17 | 239.275,53 | 237.802,24 | 6,69% | 61.230,03 | (1.858,61) | (87.353,71) |
| LFSN BRADESCO IPCA | 11.052.787,26 | 652.943,13 | 638.581,97 | 17,98% | 231.596,56 | (52.492,69) | (429.019,25) |
| LFSN BRADESCO IPCA M D | 3.579.014,57 | 226.261,71 | 220.919,66 | 6,22% | 88.884,16 | (21.940,22) | (167.844,42) |
| Total | 159.957.227,93 | 3.813.625,25 | 3.552.213,97 | 100,00% | 1.435.220,09 | 3.876,82 | (1.998.268,06) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 29/05/2020

FIM EMB IV A - CNPJ 34.081.188/0001-61

Dados Gerais

| | | | |
|------|----------------|------------|-----------|
| PL: | 153.176.769,34 | VAR / PL: | 5,078% |
| VAR: | 7.777.916,25 | ETL / PL: | 6,3677% |
| ETL: | 9.753.824,11 | VAR / CDI: | 44758,01% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|----------------|----------|--------------|------------|----------------|
| ALTA 1: | (7.865.633,38) | BAIXA 1: | 3.975.867,98 | Cenário 1: | 3.942.609,03 |
| | | | | Cenário 2: | (272.776,64) |
| | | | | Cenário 3: | (4.725.269,37) |

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 | 100,00 | - | - | 0,00% | - | - | - |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | (207.857,66) | - | - | 0,00% | - | - | - |
| INDM20 | 16.710.336,00 | 5.225.860,38 | 5.173.535,75 | 66,52% | 2.316.278,66 | - | (2.787.330,93) |
| WINM20 | 5.848.617,60 | 1.829.051,13 | 1.810.737,51 | 23,28% | 810.697,53 | - | (975.565,83) |
| DHM20 | 263.470.104,23 | 5.330,75 | 1.903,25 | 0,02% | 4.841,49 | (2.531,40) | (7.540,72) |
| DHN20 | (825.710.311,15) | 244.643,35 | (136.079,48) | -1,75% | (304.498,04) | 159.215,40 | 474.294,67 |
| DHV20 | 389.140.375,70 | 460.894,71 | 244.447,95 | 3,14% | 511.965,38 | (267.587,45) | (796.910,02) |
| DHF21 | 123.375.061,67 | 321.159,89 | 160.886,43 | 2,07% | 287.469,29 | (150.122,29) | (446.823,95) |
| DHJ21 | 55.551.098,55 | 248.459,35 | 118.598,42 | 1,52% | 189.598,94 | (98.919,06) | (294.234,26) |
| DHF22 | (29.774.413,55) | 426.652,58 | (234.361,11) | -3,01% | (244.106,58) | 126.791,87 | 376.008,17 |
| DHF24 | 23.536.591,91 | 1.177.283,04 | 890.004,23 | 11,44% | 705.575,79 | (359.720,81) | (1.053.532,80) |
| DHF27 | 577.719,67 | 57.182,08 | 46.009,76 | 0,59% | 42.314,80 | (20.866,32) | (59.785,12) |
| DOLM20 | 1.602.255,38 | 173.071,99 | (107.006,37) | -1,38% | 18.111,00 | (14.405,04) | 419.222,79 |
| COMPROMISSADA | 9.053.744,32 | 183,18 | 65,40 | 0,00% | 166,37 | (86,99) | (259,13) |
| LFT | 144.257.306,19 | 35.723,08 | 16.399,66 | 0,21% | 0,22 | - | 0,82 |
| NTNB | 181.456,17 | 22.318,73 | 21.003,44 | 0,27% | 22.602,66 | (7.270,87) | (37.599,84) |
| IBOVF85 | (187.200,97) | 830.668,49 | (822.150,04) | -10,57% | (498.879,30) | (1.624,89) | 184.108,19 |
| IBOVF880 | 87.748,02 | 562.314,80 | 556.548,30 | 7,16% | 430.677,15 | 1.106,04 | (87.554,27) |
| IBOVF91 | (53.761,85) | 446.257,49 | (441.681,15) | -5,68% | (487.776,90) | (881,20) | 53.736,22 |
| IBOVF94 | (11.270,96) | 155.074,49 | (153.484,21) | -1,97% | (427.803,87) | (308,65) | 11.271,30 |
| IBOVF950 | 8.755,24 | 116.420,37 | 115.226,49 | 1,48% | 335.353,70 | 231,61 | (8.755,46) |
| IBOVG100 | 23.995,24 | 194.895,10 | 192.888,86 | 2,48% | 309.921,20 | 486,63 | (23.944,30) |
| IBOVG90 | 263.413,25 | 1.156.148,23 | 1.144.248,47 | 14,71% | 818.111,77 | 2.840,10 | (255.118,22) |
| IBOVG95 | (158.331,87) | 1.040.463,69 | (1.029.753,63) | -13,24% | (1.105.915,90) | (2.584,19) | 157.441,51 |
| IBOVR68 | (3.243,74) | 22.168,61 | 21.941,27 | 0,28% | 3.128,14 | 43,87 | (65.304,06) |
| IBOVR70 | (3.694,84) | 26.683,49 | 26.409,86 | 0,34% | 3.591,66 | 52,76 | (81.856,72) |
| IBOVR73 | (8.576,35) | 55.417,68 | 54.849,38 | 0,71% | 8.244,99 | 109,76 | (125.138,59) |
| IBOVR750 | 53.309,18 | 360.662,44 | (356.963,88) | -4,59% | (51.666,71) | (7.13,95) | 804.863,75 |
| IBOVR800 | (56.182,09) | 342.815,65 | 339.300,10 | 4,36% | 54.114,78 | 679,82 | (523.075,48) |
| IDIFP83 | 22.321,53 | 23.485,16 | (14.818,25) | -0,19% | 5.504,69 | 74.737,66 | 169.683,22 |
| IDIFP8M | (23.292,57) | 24.708,11 | 15.589,83 | 0,20% | (5.798,69) | (78.897,87) | (179.097,95) |
| IDIFPG1 | 1.054.374,93 | 1.088.081,36 | 685.911,33 | 8,82% | (164.034,41) | (770.349,63) | (863.060,56) |
| IDIFPG2 | (1.235.020,07) | 1.168.213,63 | (736.394,67) | -9,47% | 179.601,48 | 888.510,50 | 1.016.127,23 |
| IDIFPHG | 719.582,07 | 501.431,13 | 316.025,01 | 4,06% | (81.669,68) | (475.771,07) | (586.660,32) |
| IDIFPHH | (791.678,17) | 517.273,60 | (325.994,84) | -4,19% | 84.944,58 | 509.611,98 | 639.167,04 |
| IDINNF7 | 2.007.665,73 | 621.635,27 | 450.357,37 | 5,79% | (1.525.130,73) | (1.721.120,86) | (1.813.540,29) |
| IDINNG5 | 508.554,07 | 670.229,85 | 485.613,96 | 6,24% | (517.628,09) | (517.628,09) | (517.628,09) |
| IDINNG6 | (1.891.894,44) | 1.020.647,19 | (739.473,76) | -9,51% | 1.715.519,77 | 1.814.624,71 | 1.851.533,02 |
| IDINNG7 | 1.091.490,12 | 609.856,07 | 441.850,81 | 5,68% | (1.038.047,40) | (1.078.583,05) | (1.090.066,12) |
| IDINNG8 | 1.443.915,46 | 671.560,74 | 486.549,39 | 6,26% | (1.305.451,79) | (1.388.978,79) | (1.418.222,55) |
| IDINNG9 | (2.371.685,62) | 947.809,21 | (686.682,57) | -8,83% | 2.031.516,93 | 2.208.037,93 | 2.278.319,37 |
| IDINNGB | (1.003.540,87) | 350.790,65 | (254.142,02) | -3,27% | 811.164,12 | 899.095,20 | 937.558,93 |
| Total | 177.097.935,49 | 23.753.526,76 | 7.777.916,25 | 100,00% | 3.942.609,03 | (272.776,64) | (4.725.269,37) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 29/05/2020

FI RF EMB V CREDITO PRIVADO - CNPJ 20.726.178/0001-21

Dados Gerais

| | | | |
|------|----------------|------------|-----------|
| PL: | 186.072.595,18 | VAR / PL: | 3,358% |
| VAR: | 6.247.807,43 | ETL / PL: | 4,2107% |
| ETL: | 7.835.005,26 | VAR / CDI: | 29596,86% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|-----------------|----------|--------------|------------|----------------|
| ALTA 1: | (12.607.493,23) | BAIXA 1: | (763.341,78) | Cenário 1: | 1.715.184,32 |
| | | | | Cenário 2: | (1.234.900,55) |
| | | | | Cenário 3: | (4.864.645,06) |

Parâmetros do Cálculo

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

| Produto | MTM | VAR Tot. | Comp. VAR | Comp. VAR (%) | Cenário 1 | Cenário 2 | Cenário 3 |
|------------------------------|-----------------------|---------------------|---------------------|----------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|
| CAIXA | 1.000,00 | - | - | 0,00% | - | - | - |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | (90.957,02) | - | - | 0,00% | - | - | - |
| COMPROMISSADA | 6.406.055,76 | 129,84 | 20,84 | 0,00% | 117,66 | (61,52) | (183,26) |
| CMTR33 | 3.916.099,35 | 61.570,54 | 57.081,07 | 0,91% | 9.085,64 | (3.323,46) | (20.194,19) |
| CPT11 | 4.969.999,72 | 114.133,08 | 112.241,53 | 1,80% | 22.706,79 | (8.633,44) | (47.721,06) |
| CRI HABITASE IPCA | 5.016.248,05 | 169.155,95 | 168.909,70 | 2,70% | 50.113,84 | (19.484,76) | (100.702,00) |
| CRI HABITASE IPCA | 25.796.701,27 | 1.443.091,37 | 1.441.071,97 | 23,07% | 437.622,73 | (158.354,11) | (948.184,08) |
| CRI HABITASE IPCA | 10.455.076,80 | 300.412,21 | 299.741,56 | 4,80% | 80.806,39 | (30.552,66) | (166.378,39) |
| CRI RB CAPIT IPCA M D | 10.214.434,04 | 389.031,51 | 388.720,67 | 6,22% | 143.197,14 | (52.735,96) | (287.123,07) |
| DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23 | 13.571.731,35 | 600.711,46 | 599.964,78 | 9,60% | 197.118,55 | (73.346,03) | (403.986,93) |
| DE252 CART - IPCA CART22 | 23.211.014,40 | 852.156,73 | 850.525,27 | 13,61% | 212.989,80 | (77.319,75) | (465.006,64) |
| DE252 CEMIG - IPCA CMDT33 | 2.412.025,75 | 88.699,32 | 88.497,68 | 1,42% | 21.925,17 | (7.959,31) | (47.868,41) |
| DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24 | 4.124.987,01 | 97.369,01 | 95.940,86 | 1,54% | 18.406,82 | (6.715,43) | (40.659,65) |
| DE252 DUKE GEP IPCA GEPA25 | 360.685,13 | 4.053,74 | 3.465,83 | 0,06% | 512,50 | (187,69) | (1.142,32) |
| DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17 | 11.820.713,77 | 511.364,41 | 510.719,34 | 8,17% | 165.378,79 | (61.761,95) | (338.700,87) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT11 | 4.197.726,69 | 79.503,79 | 76.302,28 | 1,22% | 13.000,35 | (4.750,65) | (28.826,70) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT21 | 1.215.771,81 | 18.207,68 | 16.759,18 | 0,27% | 2.625,98 | (960,66) | (5.838,03) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT31 | 1.977.061,03 | 22.805,66 | 21.257,55 | 0,34% | 4.279,36 | (1.563,04) | (9.478,68) |
| DE252 ECPT - IPCA ECPT41 | 3.550.657,24 | 58.953,18 | 53.867,55 | 0,86% | 9.706,52 | (3.547,59) | (21.531,50) |
| DE252 LAME IPCA - LAMEB1 | 3.141.780,93 | 120.099,91 | 119.715,57 | 1,92% | 27.879,01 | (10.139,25) | (61.128,54) |
| DE252 LIGHT IPCA - LIGHC2 | 13.655.666,35 | 39.359,45 | 14.795,77 | 0,24% | 19.470,33 | (7.082,49) | (42.715,15) |
| DE252 RD COLIN - IPCA RDCO24 | 669.768,64 | 7.717,40 | 4.677,99 | 0,07% | 1.176,99 | (430,02) | (2.608,68) |
| DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34 | 12.746.437,78 | 233.058,65 | 230.839,37 | 3,69% | 65.313,02 | (28.505,31) | (123.415,34) |
| DE252 SABESP - IPCA SBESC7 | 316.064,78 | 6.433,43 | 6.233,36 | 0,10% | 1.088,19 | (397,51) | (2.410,86) |
| DE252 TRANS AL - IPCA TAE33 | 5.350.780,84 | 175.219,91 | 174.467,11 | 2,79% | 40.831,20 | (14.841,23) | (89.408,09) |
| DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12 | 15.676.392,48 | 922.471,58 | 910.862,27 | 14,58% | 555.533,08 | (201.438,67) | (1.046.517,93) |
| FIDC CELG DIST SN B | 8.953.046,76 | 122.079,40 | (20.255,82) | -0,32% | (230.918,73) | (285.807,22) | (360.342,78) |
| FIDC VERDECARD SN3 | 6.900.000,00 | - | - | 0,00% | - | - | - |
| SANEAGOIFR IV 1 FIDC | 7.523.578,75 | 39.472,57 | 21.384,14 | 0,34% | (154.782,82) | (175.000,84) | (202.571,90) |
| Total | 208.060.549,48 | 6.477.261,80 | 6.247.807,43 | 100,00% | 1.715.184,32 | (1.234.900,55) | (4.864.645,06) |



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - Por Fundo de Investimento Exclusivo

Data: 29/05/2020

FIA RVA EMB II - CNPJ 13.294.268/0001-25

Dados Gerais

| | | | |
|------|----------------|------------|------------|
| PL: | 613.878.695,88 | VAR / PL: | 23,976% |
| VAR: | 147.182.036,55 | ETL / PL: | 30,0666% |
| ETL: | 184.572.274,97 | VAR / CDI: | 211335,59% |

Cenários de STRESS

| | | | | | |
|---------|---------------|----------|------------------|------------|-----------------|
| ALTA 1: | 40.203.589,41 | BAIXA 1: | (101.770.582,56) | Cenário 1: | 77.131.476,91 |
| | | | | Cenário 2: | 13.692.536,29 |
| | | | | Cenário 3: | (60.612.879,84) |

Parâmetros do Cálculo

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

| Produto | MTM | VAR Tot. | Comp. VAR | Comp. VAR (%) | Cenário 1 | Cenário 2 | Cenário 3 |
|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|----------------|----------------------|----------------------|------------------------|
| CAIXA | 10.000,00 | - | - | 0,00% | - | - | - |
| CONTAS A PAGAR / RECEBER | (2.050.148,37) | - | - | 0,00% | - | - | - |
| ABEV3 | 18.474.206,40 | 4.707.973,66 | 4.185.643,54 | 2,84% | 1.300.591,49 | (399.252,66) | (2.490.688,33) |
| B3SA3 | 36.077.558,65 | 9.525.037,75 | 8.730.862,94 | 5,93% | 5.655.579,15 | (621.585,16) | (7.709.006,87) |
| BBAS3 | 14.411.532,00 | 5.108.037,57 | 4.782.253,88 | 3,25% | 2.004.459,82 | (1.516.139,21) | (5.143.023,24) |
| BBDC4 | 43.699.420,10 | 10.550.827,71 | 9.716.095,43 | 6,60% | 2.530.551,69 | (6.345.767,23) | (15.796.025,80) |
| BEEF3 | 9.514.934,00 | 5.041.576,67 | 4.292.011,38 | 2,92% | 3.178.589,58 | 4.435.550,58 | 6.359.286,01 |
| BRDT3 | 12.124.892,00 | 5.323.949,30 | 5.156.740,32 | 3,50% | 4.458.336,12 | (420.694,76) | (4.858.717,91) |
| BRML3 | 8.840.772,00 | 3.038.792,78 | 2.872.828,57 | 1,95% | 123.595,09 | (1.037.077,28) | (2.385.533,83) |
| BRPR3 | 9.127.951,00 | 2.337.212,78 | 2.217.949,68 | 1,51% | 15.638,47 | (1.197.760,35) | (2.601.338,42) |
| BTOW3 | 27.477.296,10 | 13.207.573,10 | 11.667.218,02 | 7,93% | 13.627.316,51 | 10.648.903,19 | 6.920.506,59 |
| CCRO3 | 17.981.040,00 | 5.734.495,35 | 5.320.037,06 | 3,61% | 3.128.780,44 | (1.339.724,48) | (5.962.161,65) |
| CIEL3 | 6.116.595,00 | 1.383.556,38 | 829.478,48 | 0,56% | (124.519,51) | (1.544.738,06) | (2.958.987,12) |
| CPFE3 | 23.968.200,00 | 6.177.251,37 | 5.953.018,90 | 4,04% | 3.256.041,26 | 249.085,50 | (3.334.225,07) |
| CRFB3 | 5.665.336,00 | 644.083,99 | (231.600,07) | -0,16% | (333.603,04) | (745.003,98) | (1.256.923,55) |
| CSNA3 | 5.717.280,00 | 2.939.598,97 | 2.839.558,55 | 1,93% | 1.583.379,06 | 563.438,57 | (605.193,39) |
| ELET3 | 9.788.597,00 | 4.130.876,84 | 3.727.094,78 | 2,53% | 1.615.188,34 | (1.201.574,11) | (3.963.809,95) |
| ELET6 | 10.453.350,00 | 3.814.931,85 | 3.362.657,75 | 2,28% | 1.489.025,99 | (1.333.090,58) | (4.146.369,21) |
| ENGI11 | 5.861.500,00 | 1.574.597,45 | 1.402.541,50 | 0,95% | 686.565,87 | (68.532,96) | (962.583,10) |
| HAPV3 | 23.908.262,30 | 7.332.223,30 | 6.281.133,37 | 4,27% | 5.693.699,68 | (1.105.396,25) | (7.951.761,84) |
| HYPE3 | 5.396.850,00 | 874.047,74 | 536.332,70 | 0,36% | 138.873,03 | (666.946,68) | (1.389.143,39) |
| ITUB4 | 34.878.804,48 | 7.485.344,61 | 6.913.249,83 | 4,70% | 2.772.428,72 | (2.495.159,86) | (8.529.038,64) |
| JBSS3 | 13.693.901,00 | 3.579.090,82 | 2.441.303,10 | 1,66% | 176.188,26 | 1.952.442,17 | 4.756.766,77 |
| KLBN11 | 4.878.225,00 | 1.730.841,66 | 1.453.736,86 | 0,99% | 482.032,02 | 1.466.012,28 | 3.111.248,50 |
| LAME4 | 8.983.500,00 | 3.584.794,71 | 3.339.020,50 | 2,27% | 2.923.864,98 | 1.829.899,42 | 494.163,04 |
| LREN3 | 13.006.770,00 | 3.743.874,33 | 3.491.037,25 | 2,37% | 1.265.130,39 | (932.136,06) | (3.400.895,36) |
| MDIA3 | 6.080.679,00 | 1.764.912,19 | 1.576.197,45 | 1,07% | 946.921,04 | 685.064,25 | 342.543,11 |
| MGLU3 | 12.747.735,00 | 5.917.716,16 | 5.728.516,04 | 3,89% | 5.006.175,64 | 3.346.346,25 | 1.323.936,92 |
| NTCO3 | 6.997.276,00 | 3.144.846,47 | 2.921.782,67 | 1,99% | 2.179.204,47 | 373.167,18 | (1.536.286,09) |
| PCAR3 | 3.545.774,00 | 567.224,93 | 344.737,06 | 0,23% | (121.683,37) | (299.999,70) | (529.013,59) |
| PETR3 | 12.101.788,00 | 6.915.725,65 | 6.793.197,74 | 4,62% | 3.534.324,91 | 1.127.184,96 | (1.577.417,36) |
| PETR4 | 28.115.148,06 | 14.832.574,97 | 14.532.593,57 | 9,87% | 6.972.296,45 | 2.284.985,35 | (3.130.490,87) |
| RADL3 | 8.317.440,00 | 974.081,70 | 748.533,09 | 0,51% | 248.554,83 | 133.247,87 | (21.996,95) |
| RAIL3 | 12.835.341,00 | 2.793.988,00 | 2.180.339,32 | 1,48% | 457.493,49 | 276.276,81 | 32.343,91 |
| RENT3 | 6.239.532,00 | 2.717.575,16 | 2.593.951,76 | 1,76% | 1.677.674,05 | (153.082,20) | (1.992.235,10) |
| SAPR11 | 9.518.355,00 | 2.645.274,86 | 2.371.442,36 | 1,61% | 1.541.858,15 | (715.516,83) | (3.076.883,33) |
| SUZB3 | 11.270.922,00 | 3.173.198,12 | 2.196.231,83 | 1,49% | 127.545,21 | 2.456.880,55 | 6.433.587,11 |
| TIMP3 | 7.128.708,00 | 1.195.979,59 | 1.023.213,39 | 0,70% | 667.924,50 | (377.631,44) | (1.584.771,35) |
| TOTS3 | 17.712.888,00 | 6.096.099,43 | 5.744.719,92 | 3,90% | 4.436.449,24 | (289.966,08) | (5.166.829,24) |
| VALE3 | 62.258.835,00 | 16.270.434,87 | 14.512.603,21 | 9,86% | 6.156.005,79 | 7.935.961,72 | 10.446.433,01 |
| VIVT4 | 8.640.762,00 | 903.390,60 | 508.494,95 | 0,35% | 127.918,27 | (676.802,81) | (1.659.498,91) |
| WEGE3 | 6.224.304,00 | 1.447.231,12 | 947.073,32 | 0,64% | 872.730,56 | (307.402,45) | (1.610.748,00) |
| YDUQ3 | 3.315.072,00 | 1.552.088,25 | 1.416.801,94 | 0,96% | 841.563,86 | (329.125,02) | (1.416.021,63) |
| COMPROMISSADA | 23.671.067,36 | 479,78 | 180,41 | 0,00% | 434,76 | (227,32) | (677,15) |
| IBOVG94 | (2.137.760,00) | 14.088.082,50 | (14.067.760,38) | -9,56% | (14.663.761,36) | (35.429,71) | 2.128.191,65 |
| IBOV570 | (1.487.999,69) | 5.347.605,72 | 5.339.901,15 | 3,63% | 1.225.086,00 | 13.927,36 | (6.639.985,20) |
| IBOV5770 | 3.357.920,00 | 11.527.526,26 | (11.510.918,56) | -7,82% | (2.750.972,99) | (30.074,45) | 12.426.395,00 |
| Total | 614.460.411,38 | 217.446.627,03 | 147.182.036,55 | 100,00% | 77.131.476,91 | 13.692.536,29 | (60.612.879,84) |



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
Data Base: 29/05/2020



Bradesco

| INFORMAÇÕES DOS ATIVOS | | | | | | INFORMAÇÕES DE RATING | | |
|------------------------|--------|-----------------|----------------|-----------------|---------------|-----------------------|---------|----------|
| Fundo | Título | Emissor | Data Aquisição | Data Vencimento | Financeiro | S&P | Moody's | Fitch |
| FI RF EMB I | DE252 | JSLG | 01/08/13 | 15/07/20 | 344.540,41 | brAA+ | - | AA-(bra) |
| FI RF EMB I | DE252 | RD COLIN | 10/05/13 | 15/10/20 | 736.738,27 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB I | DE252 | RD COLIN | 31/07/15 | 15/10/20 | 377.248,47 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB I | DEBI | RAIZEN E | 14/07/17 | 15/10/20 | 665.583,54 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB I | DE252 | CEMIG D | 14/03/13 | 15/02/21 | 1.360.476,94 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB I | DE252 | CEMIG D | 23/02/15 | 15/02/21 | 685.370,53 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB I | DE252 | CEMIG D | 02/03/15 | 15/02/21 | 1.461.366,39 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB I | DE252 | CEMIG D | 23/04/15 | 15/02/21 | 1.556.804,30 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB I | DE252 | CEMIG D | 30/06/15 | 15/02/21 | 933.000,19 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB I | DE252 | CEMIG D | 23/07/15 | 15/02/21 | 945.764,97 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB I | DE252 | CEMIG D | 23/07/15 | 15/02/21 | 1.577.921,19 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB I | DE252 | LAME | 22/06/17 | 15/07/21 | 1.510.197,86 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB I | DE252 | LAME | 22/06/17 | 15/07/21 | 362.447,49 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB I | DE252 | LAME | 22/06/17 | 15/07/21 | 302.039,57 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB I | LFS | ITAU | 21/08/12 | 22/08/22 | 3.956.097,92 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB I | LFS | ITAU | 05/11/12 | 07/11/22 | 7.482.240,12 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB I | LFS | ITAU | 22/05/15 | 07/11/22 | 635.466,11 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB I | LFS | ITAU | 22/05/15 | 07/11/22 | 635.466,11 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB I | LFS | ITAU | 22/05/15 | 07/11/22 | 5.083.728,85 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB I | LFS | ITAU | 22/05/15 | 07/11/22 | 3.177.330,53 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB I | LFS | ITAU | 22/05/15 | 07/11/22 | 4.448.262,74 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB I | DE252 | COMGAS | 23/05/18 | 15/05/28 | 15.647.397,74 | - | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB I | DEBI | ELETROB | 25/03/20 | 15/05/29 | 3.215.479,54 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB I | DEBI | ELETROB | 25/03/20 | 15/05/29 | 1.331.516,15 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB I | DEBI | ELETROB | 26/03/20 | 15/05/29 | 2.552.045,62 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB I | DEBI | ELETROB | 26/03/20 | 15/05/29 | 2.730.433,98 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB I | DEBI | NEOENERG | 25/03/20 | 15/06/29 | 466.139,77 | brAA+ | - | - |
| FI RF EMB I | DEBI | NEOENERG | 25/03/20 | 15/06/29 | 4.633.661,91 | brAA+ | - | - |
| FI RF EMB I | DEBI | ENTREVIA | 24/03/20 | 15/12/30 | 5.090.665,25 | brAA | - | - |
| FI RF EMB I | DEBI | ENTREVIA | 25/03/20 | 15/12/30 | 5.105.835,57 | brAA | - | - |
| FI RF EMB I A | DE252 | AMPL | 21/12/17 | 15/12/20 | 1.237.631,71 | - | - | - |
| FI RF EMB I A | DE252 | NCF PART | 19/10/16 | 23/12/20 | 911.356,28 | - | - | AA+(bra) |
| FI RF EMB I A | DE252 | GUAR | 14/05/18 | 25/04/21 | 1.061.301,80 | - | - | AA-(bra) |
| FI RF EMB I A | DE252 | SABEREDU | 15/08/18 | 15/08/21 | 778.774,85 | - | - | AA+(bra) |
| FI RF EMB I A | DE252 | NATURA | 28/09/17 | 25/09/21 | 618.561,99 | brAAA | - | AA(bra) |
| FI RF EMB I A | DE252 | LOCALIZA | 12/12/16 | 12/01/22 | 597.016,45 | brAAA | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB I A | DE252 | TELEF BR | 08/02/17 | 08/02/22 | 2.218.441,28 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB I A | DE252 | LAME | 28/04/17 | 15/04/22 | 893.688,98 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB I A | DE252 | SUL AME | 29/01/18 | 27/10/22 | 1.246.278,84 | - | - | A+(bra) |
| FI RF EMB I A | LFSC | BRADESCO | 14/11/18 | 15/03/24 | 276.273,71 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB I A | DE252 | MOV_PART | 04/01/19 | 07/06/24 | 1.092.080,41 | - | - | A+(bra) |
| FI RF EMB I A | LFSC | ITAUBB | 17/01/19 | 16/09/24 | 581.213,01 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB I A | LFSC | ITAUBB | 12/02/19 | 15/01/25 | 2.336.695,53 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB I A | FIDC | CHEMICAL IX SEM | - | - | 852.036,07 | - | Aaa.br | - |
| FI RF EMB II | DE252 | JSLG | 01/08/13 | 15/07/20 | 505.376,75 | brAA+ | - | AA-(bra) |
| FI RF EMB II | DE252 | RD COLIN | 10/05/13 | 15/10/20 | 130.396,15 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB II | DE252 | TRANS AL | 25/02/14 | 15/10/20 | 1.538.547,87 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB II | DE252 | DUKE GEP | 11/06/14 | 20/05/21 | 1.785.477,59 | brAAA | Aa1.br | - |
| FI RF EMB II | DE252 | LAME | 24/07/13 | 15/07/21 | 829.134,49 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB II | DE252 | LAME | 20/08/14 | 15/07/21 | 833.604,45 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB II | LFSN | B VOTORA | 04/03/15 | 02/03/22 | 19.469.356,04 | brAAA | Aa3.br | - |
| FI RF EMB II | LFSN | B VOTORA | 09/06/15 | 07/06/22 | 9.097.316,06 | brAAA | Aa3.br | - |



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO - EMBRAER PREV
Data Base: 29/05/2020



Bradesco

| INFORMAÇÕES DOS ATIVOS | | | | | | INFORMAÇÕES DE RATING | | |
|------------------------|--------|----------|----------------|-----------------|---------------|-----------------------|---------|----------|
| Fundo | Título | Emissor | Data Aquisição | Data Vencimento | Financeiro | S&P | Moody's | Fitch |
| FI RF EMB II | LFSN | B VOTORA | 30/06/15 | 28/06/22 | 9.078.953,92 | brAAA | Aa3.br | - |
| FI RF EMB II | LFSN | BRADESCO | 06/11/15 | 04/11/22 | 5.432.316,72 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB II | LFSN | BRADESCO | 18/11/15 | 16/11/22 | 13.396.390,35 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB II | DE252 | SABESP | 24/02/15 | 15/01/23 | 3.689.921,93 | brAAA | Aa2.br | AA(bra) |
| FI RF EMB II | DE252 | SABESP | 20/10/14 | 15/01/23 | 1.452.445,54 | brAAA | Aa2.br | AA(bra) |
| FI RF EMB II | DE252 | SABESP | 21/10/14 | 15/01/23 | 7.249.672,51 | brAAA | Aa2.br | AA(bra) |
| FI RF EMB II | DE252 | LAME | 28/04/17 | 15/04/24 | 5.008.057,69 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB II | DE252 | PETR | 25/08/17 | 15/08/24 | 14.918.249,36 | AAA | Aaa.br | AA(bra) |
| FI RF EMB II | DE252 | SABESP | 19/02/18 | 15/02/25 | 7.519.184,48 | brAAA | - | AA(bra) |
| FI RF EMB II | DE252 | CSMG | 26/07/18 | 15/07/25 | 12.718.521,70 | - | Aa3.br | AA(bra) |
| FI RF EMB II | DE252 | COMGAS | 23/05/18 | 15/05/28 | 17.965.530,74 | - | - | AAA(bra) |
| FIM EMB II A | DE252 | NCF PART | 19/10/16 | 23/12/20 | 2.126.497,98 | - | - | AA+(bra) |
| FIM EMB II A | DE252 | GUAR | 14/05/18 | 25/04/21 | 245.671,71 | - | - | AA-(bra) |
| FIM EMB II A | DE252 | SABEREDU | 15/08/18 | 15/08/21 | 246.447,74 | - | - | AA+(bra) |
| FIM EMB II A | DE252 | NATURA | 28/09/17 | 25/09/21 | 1.097.448,70 | brAAA | - | AA(bra) |
| FIM EMB II A | LFSN | B VOTORA | 28/07/16 | 04/10/21 | 2.181.054,89 | brAAA | Aa3.br | - |
| FIM EMB II A | DE252 | LOCALIZA | 12/12/16 | 12/01/22 | 527.364,53 | brAAA | - | AAA(bra) |
| FIM EMB II A | DE252 | TELEF BR | 08/02/17 | 08/02/22 | 2.997.893,62 | brAAA | - | - |
| FIM EMB II A | DE252 | ENERSUL | 22/09/17 | 15/09/22 | 786.097,88 | - | - | AAA(bra) |
| FIM EMB II A | LFSC | BRADESCO | 14/11/18 | 15/03/24 | 276.273,71 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FIM EMB II A | LFSC | ITAUUBB | 17/01/19 | 16/09/24 | 290.606,51 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FIM EMB II A | LFSC | ITAUUBB | 12/02/19 | 15/01/25 | 2.336.695,53 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | LFS | B.BRASIL | 15/05/15 | 01/06/20 | 10.481.327,46 | brAA- | Aa1.br | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | CEMAR | 28/05/14 | 21/06/20 | 1.936.832,66 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | CEMAR | 24/07/15 | 21/06/20 | 1.102.524,96 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | CEMAR | 24/07/15 | 21/06/20 | 618.489,61 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | CEMAR | 24/07/15 | 21/06/20 | 139.832,43 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | CEMAR | 24/07/15 | 21/06/20 | 134.454,26 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | CEMAR | 24/07/15 | 21/06/20 | 242.017,67 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | TRANS AL | 25/06/13 | 15/10/20 | 512.855,86 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | TRANS AL | 27/06/13 | 15/10/20 | 128.213,96 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | TRANS AL | 16/09/13 | 15/10/20 | 512.855,86 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | TRANS AL | 10/10/13 | 15/10/20 | 256.427,93 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | TRANS AL | 24/07/13 | 15/10/20 | 398.489,00 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | SANEPAR | 24/06/15 | 15/11/20 | 1.061.855,87 | - | A2.br | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | CDBPR | B.MERCED | 09/08/19 | 04/01/21 | 5.450.634,41 | - | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | IGUATEMI | 06/05/14 | 15/02/21 | 3.188.641,24 | - | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | IGUATEMI | 06/05/14 | 15/02/21 | 4.782.962,31 | - | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | LAME | 24/07/13 | 15/07/21 | 7.991.657,72 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | LAME | 24/06/15 | 15/07/21 | 1.950.670,05 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | LAME | 24/07/15 | 15/07/21 | 499.847,14 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | LAME | 24/07/15 | 15/07/21 | 499.847,14 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | CEMIG G | 05/07/13 | 15/02/22 | 1.047.140,48 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | CEMIG G | 05/07/13 | 15/02/22 | 261.785,12 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | CEMIG G | 08/08/13 | 15/02/22 | 1.869.145,76 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | CEMIG G | 02/09/13 | 15/02/22 | 265.973,68 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | CEMIG G | 05/09/13 | 15/02/22 | 1.905.795,67 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | SUL AME | 13/10/14 | 15/05/22 | 2.731.448,24 | - | - | A+(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | ECPT | 24/10/13 | 15/07/22 | 546.463,77 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | ECPT | 24/10/13 | 15/10/22 | 683.338,77 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | ECORODOV | 02/06/14 | 15/10/22 | 4.572.531,51 | brAAA | A2.br | - |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | ECORODOV | 13/08/14 | 15/10/22 | 1.526.201,85 | brAAA | A2.br | - |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | ECORODOV | 20/10/14 | 15/10/22 | 1.908.731,83 | brAAA | A2.br | - |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | LFS | ITAU | 26/05/14 | 14/11/22 | 6.381.710,48 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | LIGHT | 09/01/20 | 15/05/23 | 1.153.291,55 | - | - | A+(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | LIGHT | 06/02/20 | 15/05/23 | 2.581.176,32 | - | - | A+(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | DUKE GEP | 09/08/13 | 16/07/23 | 14.800.648,75 | brAAA | Aa1.br | - |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | LFSC | BRADESCO | 16/11/18 | 15/03/24 | 276.273,71 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | LFSC | BRADESCO | 16/11/18 | 15/03/24 | 276.273,71 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | LFSC | BRADESCO | 16/11/18 | 15/03/24 | 828.821,12 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | SONAE | 18/09/18 | 15/07/24 | 342.848,47 | - | - | AA+(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | SONAE | 18/09/18 | 15/07/24 | 399.989,88 | - | - | AA+(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | SONAE | 18/09/18 | 15/07/24 | 399.989,88 | - | - | AA+(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | LFSC | ITAUUBB | 11/01/19 | 16/09/24 | 1.163.880,74 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | TRANS AL | 02/09/13 | 15/10/24 | 736.150,41 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | TRANS AL | 05/09/13 | 15/10/24 | 1.295.624,72 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | TRANS AL | 25/09/13 | 15/10/24 | 1.472.300,82 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | TRANS AL | 16/07/13 | 15/10/24 | 736.150,41 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | TRANS AL | 22/07/13 | 15/10/24 | 901.048,10 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | TRANS AL | 24/07/15 | 15/10/24 | 751.741,30 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | TRANS AL | 24/07/15 | 15/10/24 | 2.181.067,60 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | CCR | 12/12/17 | 15/11/24 | 4.903.972,94 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | ECORODOV | 14/12/17 | 15/11/24 | 3.361.958,80 | brAAA | A2.br | - |



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO - EMBRAER PREV
Data Base: 29/05/2020



Bradesco

| INFORMAÇÕES DOS ATIVOS | | | | | | INFORMAÇÕES DE RATING | | |
|-----------------------------|--------|----------|----------------|-----------------|--------------|-----------------------|---------|-----------|
| Fundo | Título | Emissor | Data Aquisição | Data Vencimento | Financeiro | S&P | Moody's | Fitch |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | LFSC | CEF | 27/09/19 | 30/11/24 | 1.665.145,94 | brAAA | Aa1.br | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | DASA | 20/12/18 | 10/12/24 | 1.856.388,17 | - | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | LFSN | BRADESCO | 26/10/16 | 27/01/25 | 8.986.938,04 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | SABESP | 19/02/18 | 15/02/25 | 1.095.931,28 | brAAA | - | AA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | LFSN | BRADESCO | 31/07/18 | 01/08/25 | 2.958.170,30 | brAAA | Aa1.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | USIMINAS | 23/10/19 | 30/09/25 | 4.467.608,49 | brAA | - | - |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | ALUPAR | 09/12/19 | 15/10/25 | 2.364.912,92 | - | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | GETI | 22/04/19 | 15/03/27 | 1.838.226,56 | - | Aa1.br | - |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DEBI | JAGUARA | 28/06/18 | 15/06/27 | 1.691.983,37 | - | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DEBI | ENERGMIR | 28/06/18 | 15/06/27 | 1.000.553,11 | - | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB IV CRED PRIV | DE252 | COMGAS | 23/05/18 | 15/05/28 | 6.954.399,00 | - | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | LIGHT | 07/07/17 | 15/07/20 | 6.246.354,42 | - | - | A+(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | LIGHT | 11/10/17 | 15/07/20 | 1.630.026,08 | - | - | A+(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | LIGHT | 26/10/17 | 15/07/20 | 3.184.664,67 | - | - | A+(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | LIGHT | 30/11/17 | 15/07/20 | 871.241,21 | - | - | A+(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | LIGHT | 30/11/17 | 15/07/20 | 3.070.954,66 | - | - | A+(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | RD COLIN | 14/04/16 | 15/10/20 | 32.226,62 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | RD COLIN | 26/09/16 | 15/10/20 | 622.917,39 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | DUKE GEP | 20/09/16 | 20/05/21 | 455.696,13 | brAAA | Aa1.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CEMIG G | 07/08/18 | 15/02/22 | 2.624.237,81 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CEMIG G | 07/08/18 | 15/02/22 | 126.945,68 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CEMIG G | 07/08/18 | 15/02/22 | 890.700,86 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 05/02/16 | 15/04/22 | 41.100,10 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 16/02/16 | 15/04/22 | 165.395,24 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 01/03/16 | 15/04/22 | 194.209,72 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 24/03/17 | 15/04/22 | 714.495,13 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 05/02/16 | 15/07/22 | 66.067,81 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 16/02/16 | 15/07/22 | 577.912,46 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 24/03/17 | 15/07/22 | 1.137.968,23 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 16/05/17 | 15/07/22 | 72.865,15 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 05/02/16 | 15/10/22 | 64.293,50 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 16/02/16 | 15/10/22 | 563.094,94 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 26/09/16 | 15/10/22 | 1.521.535,39 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 24/03/17 | 15/10/22 | 1.117.406,30 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 05/02/16 | 15/01/23 | 62.631,10 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 11/02/16 | 15/01/23 | 219.382,05 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 01/03/16 | 15/01/23 | 1.055.975,74 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 25/08/16 | 15/01/23 | 556.536,12 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 25/08/16 | 15/01/23 | 357.964,02 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | SABESP | 10/10/16 | 15/01/23 | 283.762,41 | brAAA | Aa2.br | AA(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 24/03/17 | 15/01/23 | 527.145,94 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECPT | 16/05/17 | 15/01/23 | 992.716,72 | - | A2.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | RD COLIN | 25/05/15 | 15/04/23 | 1.409.884,64 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | RD COLIN | 27/05/15 | 15/04/23 | 1.407.931,68 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | RD COLIN | 27/05/15 | 15/04/23 | 1.549.239,75 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | RD COLIN | 01/06/15 | 15/04/23 | 1.816.716,29 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | RD COLIN | 26/07/17 | 15/04/23 | 3.372.017,01 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | RD COLIN | 07/08/18 | 15/04/23 | 1.049.998,68 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | RD COLIN | 07/08/18 | 15/04/23 | 595.945,20 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | RD COLIN | 07/08/18 | 15/04/23 | 1.574.998,02 | brAA+ | A3.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | DUKE GEP | 12/08/15 | 16/07/23 | 3.624.397,38 | brAAA | Aa1.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CACHOEIR | 24/11/16 | 11/11/23 | 440.738,60 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CACHOEIR | 30/11/16 | 11/11/23 | 1.185.708,47 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CACHOEIR | 19/12/16 | 11/11/23 | 1.127.070,49 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CACHOEIR | 13/02/17 | 11/11/23 | 681.460,30 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CACHOEIR | 24/03/17 | 11/11/23 | 495.669,55 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CACHOEIR | 24/03/17 | 11/11/23 | 762.554,39 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CACHOEIR | 24/03/17 | 11/11/23 | 495.669,55 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CACHOEIR | 16/05/17 | 11/11/23 | 615.924,43 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CACHOEIR | 16/05/17 | 11/11/23 | 823.543,34 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CACHOEIR | 23/01/17 | 11/11/23 | 376.477,15 | brAAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | LAME | 28/04/17 | 15/04/24 | 2.670.964,10 | - | - | AA(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | TRANS AL | 18/05/16 | 15/10/24 | 1.919.573,83 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | TRANS AL | 03/06/16 | 15/10/24 | 706.875,94 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | TRANS AL | 03/06/16 | 15/10/24 | 424.125,56 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | TRANS AL | 20/06/16 | 15/10/24 | 1.410.509,69 | brAA- | Aaa.br | AAA(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 08/10/14 | 10/11/24 | 2.106.157,79 | - | - | A-sf(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 03/11/14 | 10/11/24 | 304.216,92 | - | - | A-sf(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 01/12/14 | 10/11/24 | 1.228.049,15 | - | - | A-sf(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 01/12/14 | 10/11/24 | 1.228.049,15 | - | - | A-sf(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 28/10/14 | 10/11/24 | 919.234,96 | - | - | A-sf(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 03/11/14 | 10/12/24 | 822.827,41 | - | - | A-sf(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 03/11/14 | 10/12/24 | 822.827,41 | - | - | A-sf(bra) |



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO - EMBRAER PREV
Data Base: 29/05/2020



Bradesco

| INFORMAÇÕES DOS ATIVOS | | | | | | INFORMAÇÕES DE RATING | | |
|-----------------------------|--------|-----------------|----------------|-----------------|---------------|-----------------------|---------|------------|
| Fundo | Título | Emissor | Data Aquisição | Data Vencimento | Financeiro | S&P | Moody's | Fitch |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 27/07/15 | 10/12/24 | 638.262,75 | - | - | A-sf(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 28/10/14 | 10/12/24 | 1.237.499,28 | - | - | A-sf(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 28/10/14 | 10/12/24 | 2.268.748,68 | - | - | A-sf(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 02/10/14 | 15/12/24 | 212.967,28 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 02/10/14 | 15/12/24 | 930.737,57 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 03/11/14 | 15/12/24 | 1.283.465,37 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 11/11/14 | 15/12/24 | 1.418.357,33 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 14/10/14 | 15/12/24 | 1.634.896,70 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 17/12/14 | 15/12/24 | 3.104.384,18 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 18/12/14 | 15/12/24 | 3.374.337,74 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 14/01/15 | 15/12/24 | 2.969.398,45 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 22/10/14 | 15/12/24 | 2.022.595,03 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 27/07/15 | 15/12/24 | 1.187.423,74 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 27/07/15 | 15/12/24 | 332.396,14 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 03/08/15 | 15/12/24 | 767.153,98 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CART | 03/08/15 | 15/12/24 | 423.197,32 | brBB- | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | SABESP | 19/02/18 | 15/02/25 | 4.666.475,37 | brAAA | - | AA(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | CEMIG | 07/08/18 | 15/02/25 | 1.989.435,03 | brA+ | Baa1.br | A+(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | ECORODOV | 04/07/18 | 15/06/25 | 10.211.732,15 | - | A2.br | AA(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 27/03/15 | 20/06/25 | 865.069,57 | - | - | A-(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 27/03/15 | 20/06/25 | 1.730.139,14 | - | - | A-(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 29/05/15 | 20/06/25 | 2.172.368,77 | - | - | A-(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 18/06/15 | 20/06/25 | 865.018,88 | - | - | A-(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 01/07/15 | 20/06/25 | 2.810.363,43 | - | - | A-(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 27/07/15 | 20/06/25 | 1.934.358,40 | - | - | A-(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 27/07/15 | 20/06/25 | 1.289.572,27 | - | - | A-(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | HABITASE | 04/08/15 | 20/06/25 | 1.295.281,99 | - | - | A-(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DE252 | AEGEA SA | 26/07/18 | 15/07/25 | 11.755.300,42 | brA | Aa1.br | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | RB CAPIT | 18/12/17 | 06/11/27 | 4.306.633,44 | - | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | RB CAPIT | 21/12/17 | 06/11/27 | 1.256.771,46 | - | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | CRI | RB CAPIT | 26/01/18 | 06/11/27 | 4.502.347,76 | - | - | AAA(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DEBI | ENTREVIA | 13/03/18 | 15/12/30 | 10.354.287,40 | brAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DEBI | ENTREVIA | 15/06/18 | 15/12/30 | 508.903,11 | brAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DEBI | ENTREVIA | 15/06/18 | 15/12/30 | 508.903,11 | brAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DEBI | ENTREVIA | 15/06/18 | 15/12/30 | 508.903,11 | brAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DEBI | ENTREVIA | 15/06/18 | 15/12/30 | 507.426,98 | brAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | DEBI | ENTREVIA | 15/06/18 | 15/12/30 | 508.903,11 | brAA | - | - |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | FIDC | SANE INFII MEZA | - | - | 7.527.126,87 | - | - | Aasf(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | FIDC | CELG DIST SN B | - | - | 8.956.846,17 | - | - | AA-sf(bra) |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | FIDC | VERDECARD SN3 | - | - | 6.900.000,00 | brAAA | - | - |

Observação: Em Maio de 2020, 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 2020.

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

Data: 29/05/2020

| Patrimônio Líquido da EMBRAER PREV | | 3.222.386.318,53 | | | |
|---|---------|--|------------------|------------|------------|
| Tópico do Enquadramento | Limite | Aplicação Atual | Valor Limite | % Aplicado | Status |
| % do Segmento RF/PL PLANO | 100,00% | 2.531.631.393,39 | 3.222.386.318,53 | 78,56% | Enquadrado |
| % do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN | 100,00% | 2.008.002.124,90 | 3.222.386.318,53 | 62,31% | Enquadrado |
| % do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional | 80,00% | 523.629.268,49 | 2.577.909.093,24 | 16,25% | Enquadrado |
| % do PL em FIDC | 20,00% | Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's | 644.477.273,31 | 0,00% | Enquadrado |
| % do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira | 10,00% | Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ. | 322.238.636,65 | 0,00% | Enquadrado |
| % do PL em Instituições Financeiras | 25,00% | Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ. | 805.596.579,63 | 0,00% | Enquadrado |
| % de uma mesma Série de Debêntures | 25,00% | Verificar Rel. de Diversificação Debêntures | 805.596.579,63 | 0,00% | Enquadrado |
| % do PL em RV | 70,00% | 593.097.332,09 | 2.255.670.384,56 | 18,41% | Enquadrado |
| % do capital votante de uma empresa | 25,00% | Verificar Rel. de Diversificação RV | 805.596.579,63 | 0,00% | Enquadrado |
| % do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários | 20,00% | 63.868.497,01 | 644.477.273,31 | 1,98% | Enquadrado |
| % do PL da Fundação em Empréstimos | 15,00% | 37.004.565,14 | 483.357.966,99 | 1,15% | Enquadrado |
| % do PL da Fundação em Investimentos Estruturados | 20,00% | 0,00 | 644.477.273,31 | 0,00% | Enquadrado |
| % do PL da Fundação em Investimentos no Exterior | 10,00% | 0,00 | 322.238.636,65 | 0,00% | 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



Bradesco

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS - EMBRAER PREV

| FI RF 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 |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |
| 04/05/2020 | FI RF EMB I A | SANT GES | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 2,2314% | 2,1908% | 1,9028% | 3,2878% | 0,0406% | NÃO |

| FIM EMB II A | | | | | | | | | | | | |
|--------------|--------------|----------|-----------|--------|------------|--------|-----------|----------|----------|----------|----------|---------------|
| FONTE ANBIMA | | | | | | | | | | | | |
| DT | FUNDO | GESTOR | CORRETORA | TÍTULO | VENC. | C/V | TX. OPER. | TX. IND. | TX. MÍN. | TX. MÁX. | DIF. TX. | FORA DO TÚNEL |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 20/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | XP_INV | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6668% | 1,5519% | 1,2732% | 2,6564% | 0,1149% | NÃO |
| 21/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | LIQUIDEZ | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6310% | 1,4599% | 1,2052% | 2,5882% | 0,1711% | NÃO |
| 21/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | LIQUIDEZ | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6310% | 1,4599% | 1,2052% | 2,5882% | 0,1711% | NÃO |
| 21/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | LIQUIDEZ | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6310% | 1,4599% | 1,2052% | 2,5882% | 0,1711% | NÃO |
| 21/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | LIQUIDEZ | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6310% | 1,4599% | 1,2052% | 2,5882% | 0,1711% | NÃO |
| 21/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | LIQUIDEZ | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6310% | 1,4599% | 1,2052% | 2,5882% | 0,1711% | NÃO |
| 21/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | LIQUIDEZ | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6310% | 1,4599% | 1,2052% | 2,5882% | 0,1711% | NÃO |
| 21/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | LIQUIDEZ | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6310% | 1,4599% | 1,2052% | 2,5882% | 0,1711% | NÃO |
| 21/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | LIQUIDEZ | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6310% | 1,4599% | 1,2052% | 2,5882% | 0,1711% | NÃO |
| 21/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | LIQUIDEZ | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6310% | 1,4599% | 1,2052% | 2,5882% | 0,1711% | NÃO |
| 21/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | LIQUIDEZ | NTN-B | 15/08/2022 | Venda | 1,6310% | 1,4599% | 1,2052% | 2,5882% | 0,1711% | NÃO |
| 29/05/2020 | FIM EMB II A | SULAM GE | LIQUIDEZ | LFT | 01/09/2023 | Compra | 0,0294% | 0,0294% | 0,0271% | 0,0338% | 0,0000% | NÃO |

| FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A | | | | | | | | | | | | |
|---|--------------|--------|-----------|--------|------------|--------|-----------|----------|----------|----------|----------|---------------|
| FONTE ANBIMA | | | | | | | | | | | | |
| DT | FUNDO | GESTOR | CORRETORA | TÍTULO | VENC. | C/V | TX. OPER. | TX. IND. | TX. MÍN. | TX. MÁX. | DIF. TX. | FORA DO TÚNEL |
| 11/05/2020 | FIM EMB IV A | MAUA | ÁTIVA | LFT | 01/03/2025 | Compra | 0,0345% | 0,0345% | 0,0308% | 0,0382% | 0,0000% | 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.