



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Novembro/2021





1. INTRODUÇÃO

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

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

2. RISCO DE MERCADO

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

2.1 Relatório Detalhado de Risco



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.685.660.857,49	VAR / PL:	2,754%
VAR:	101.517.607,48	ETL / PL:	3,4541%
ETL:	127.307.219,02	VAR / CDI:	9414,71%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(178.408.355,60)	BAIXA 1:	244.004.454,83	Cenário 1:	380.987.205,72
				Cenário 2:	(70.110.651,87)
				Cenário 3:	(454.024.821,82)

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	2.091.772,66	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	1.389.741,61	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	21.996.417,80	3.977.746,31	896.109,71	0,88%	(4.778.605,83)	(20.994,75)	8.686.981,51
AIEC11	901.276,25	39.396,93	19.213,14	0,02%	54.341,29	-	(68.925,62)
ALPA4	337.455,32	51.221,62	21.659,34	0,02%	110.913,34	374,08	(108.103,40)
ALSO3	1.560.167,00	249.395,30	212.232,60	0,21%	139.700,97	521,71	(171.621,50)
AMER3	3.315.207,40	708.430,23	19.548,98	0,02%	251.559,43	-	(313.650,25)
ANIM3	54.756,00	10.503,80	7.965,88	0,01%	32.328,04	99,14	(25.608,30)
ASAI3	4.441.149,90	934.261,72	(43.895,37)	-0,04%	1.931.640,22	-	(1.722.372,63)
AZUL4	393.081,66	78.055,42	37.528,22	0,04%	216.068,46	671,88	(176.329,35)
B3SA3	22.684.578,00	2.100.579,24	464.914,31	0,46%	1.227.123,06	4.659,69	(1.567.228,27)
Banco BTG Pactual SA UNT	18.100.601,25	1.750.647,38	307.378,72	0,30%	4.364.338,28	15.249,86	(4.604.397,29)
BBAS3	15.061.869,03	1.407.318,63	877.131,81	0,86%	835.287,33	3.169,74	(1.065.174,33)
BBDC3	1.230.479,20	102.854,15	35.084,34	0,03%	62.466,34	237,58	(80.076,60)
BBDC4	30.645.260,31	2.664.999,99	594.504,35	0,59%	1.761.872,41	6.679,46	(2.241.690,41)
BBRK3	20.313,00	4.223,36	(1.535,09)	0,00%	11.266,19	34,97	(9.160,49)
BBSE3	1.376.940,20	172.513,19	(81.493,10)	-0,08%	(182.643,28)	(763,72)	293.761,03
BEEF3	107.251,35	19.765,18	5.621,45	0,01%	18.162,39	65,43	(20.539,99)
BIDI11	4.802.896,44	978.218,33	399.890,38	0,39%	1.497.685,89	5.085,04	(1.481.508,09)
BIDI3	938,96	-	-	0,00%	-	-	-
BIDI4	133.400,00	24.521,93	9.229,25	0,01%	42.975,66	145,32	(42.126,50)
BKBR3	204.400,00	41.683,02	17.287,69	0,02%	(401,36)	(1,57)	546,67
BLCP11	1.526.877,30	-	-	0,00%	-	-	-
BMGB4	175.784,00	20.433,40	852,96	0,00%	68.238,85	224,93	(63.219,19)
BMLC11	2.027.821,20	-	-	0,00%	-	-	-
BPAN4	2.582.293,80	488.631,40	(54.949,16)	-0,05%	1.608.934,03	4.880,44	(1.245.141,70)
BPML11	1.241.176,37	52.283,97	(8.286,35)	-0,01%	80.825,42	305,31	(101.971,99)
BRAP4	1.212.140,40	117.637,84	34.120,65	0,03%	274.982,18	966,58	(294.038,11)
BRFS3	847.885,20	119.426,38	48.095,41	0,05%	207.118,55	722,76	(217.864,94)
BRIT3	109.190,00	22.479,23	(3.126,57)	0,00%	94.542,08	-	(62.406,90)
BRKM5	703.238,40	129.126,49	(17.511,86)	-0,02%	219.765,10	745,96	(217.261,57)
BRML3	9.035.019,84	1.739.816,50	1.431.740,91	1,41%	212.379,00	818,45	(280.805,61)
CASH3	313.079,69	100.928,55	78.488,20	0,08%	260.840,06	-	(175.676,20)
CBAV3	151.088,00	39.290,59	(3.316,87)	0,00%	47.973,46	-	(47.217,55)
CBOP11	41.663,00	2.307,11	(1.245,96)	0,00%	3.511,93	13,15	(4.338,90)
CCRO3	656.599,46	47.405,15	19.016,38	0,02%	48.451,85	182,28	(60.548,91)
CEOC11	767.012,50	86.007,34	(55.924,15)	-0,06%	171.735,07	604,41	(184.152,87)
CESP6	8.153.204,64	713.149,16	(414.582,00)	-0,41%	(789.565,27)	(3.237,03)	1.210.341,75
CIEL3	2.596.541,76	360.945,54	(40.887,32)	-0,04%	347.707,45	1.272,51	(407.633,20)
CLSA3	3.051.815,00	138.932,77	(36.425,02)	-0,04%	-	-	-



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.685.660.857,49	VAR / PL:	2,754%
VAR:	101.517.607,48	ETL / PL:	3,4541%
ETL:	127.307.219,02	VAR / CDI:	9414,71%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(178.408.355,60)	BAIXA 1:	244.004.454,83	Cenário 1:	380.987.205,72
				Cenário 2:	(70.110.651,87)
				Cenário 3:	(454.024.821,82)

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
CMIG4	766.407,90	109.044,03	22.068,80	0,02%	107.249,87	391,45	(124.956,23)
CNES11	537.922,44	38.835,54	(5.330,51)	-0,01%	70.895,28	259,70	(83.295,78)
CNRD11	78.302,00	-	-	0,00%	-	-	-
COGN3	227.414,83	23.827,89	4.251,83	0,00%	49.366,69	174,24	(53.282,33)
CPFE3	7.352.124,30	638.672,48	94.530,08	0,09%	36.649,41	142,53	(49.511,66)
CPLE6	487.865,80	61.161,20	14.494,10	0,01%	73.805,68	268,02	(85.000,17)
CRFB3	2.595.957,00	144.663,87	12.812,98	0,01%	349.022,43	1.277,01	(408.948,21)
CSAN3	1.966.816,20	218.699,21	181.360,04	0,18%	374.911,80	1.338,30	(415.156,88)
CSED3	2.593.248,00	574.633,09	446.340,79	0,44%	811.688,61	-	(802.089,99)
CSNA3	741.227,90	86.221,33	54.193,61	0,05%	382.081,70	1.202,34	(319.914,12)
CURY3	77.292,00	7.515,55	4.194,27	0,00%	9.794,82	35,96	(11.568,71)
CVCB3	166.495,65	34.687,84	14.920,23	0,01%	88.893,59	277,93	(73.402,04)
CYRE3	1.432.332,72	195.695,43	149.998,04	0,15%	485.917,99	1.632,12	(469.275,66)
DXCO3	257.578,95	32.696,30	24.430,75	0,02%	27.046,16	-	(32.681,44)
ECOR3	143.426,61	14.094,20	8.404,50	0,01%	21.748,24	78,97	(25.038,00)
EGIE3	5.309.674,96	253.993,48	(38.416,13)	-0,04%	(326.301,69)	(1.312,74)	477.920,28
ELET3	3.569.614,36	413.267,80	2.463,07	0,00%	948.996,47	3.282,33	(978.465,97)
ELET6	6.665.075,77	859.625,98	31.639,50	0,03%	2.061.849,64	7.007,42	(2.044.058,58)
ENAT3	1.938.800,00	325.521,24	(71.050,32)	-0,07%	399.282,57	1.415,98	(435.595,51)
ENBR3	256.444,71	19.571,54	3.844,73	0,00%	(39.725,80)	(168,22)	65.903,37
ENEV3	3.846.934,46	409.812,64	281.328,01	0,28%	139.007,27	532,42	(181.159,61)
ENGI11	576.489,20	61.558,01	48.741,54	0,05%	58.671,24	217,87	(71.139,46)
EQLT3	13.870.309,18	1.030.021,41	170.368,05	0,17%	1.494.915,06	5.536,08	(1.801.085,57)
ESPA3	1.985.296,43	484.767,91	274.568,11	0,27%	1.186.755,43	-	(935.103,33)
EUCATEX PN	109.060,00	10.919,42	3.761,38	0,00%	18.247,85	65,80	(20.678,48)
EWJ_US	4.424.542,90	186.118,04	(98.668,08)	-0,10%	(79.151,80)	(39.820,89)	109.875,10
EZTC3	95.975,88	12.535,59	8.727,00	0,01%	35.768,66	118,60	(33.571,13)
FLRY3	276.246,00	25.469,94	7.680,43	0,01%	43.489,80	157,50	(49.775,13)
GALG11	1.251.305,16	40.562,45	3.805,44	0,00%	84.563,79	-	(106.399,61)
GALG13	492,10	8,38	(3,47)	0,00%	-	-	-
GETT11	16.380,65	9.689,21	(783,71)	0,00%	33.991,34	-	(12.821,21)
GGBR4	8.348.828,40	789.029,33	67.649,51	0,07%	516.356,08	1.953,52	(653.811,44)
GGPS3	3.619.509,64	376.068,74	36.023,24	0,04%	675.835,42	-	(751.253,80)
GMAT3	5.625.811,59	1.350.123,41	(729.969,80)	-0,72%	1.583.879,29	5.443,38	(1.609.854,92)
GNDI3	13.631.056,95	2.020.803,08	1.032.459,27	1,02%	175.357,84	679,32	(234.729,28)
GOAU4	1.215.857,25	108.314,35	(14.670,57)	-0,01%	86.839,34	327,06	(108.802,64)
GOLL4	133.504,80	23.402,49	12.392,17	0,01%	47.679,17	159,04	(45.343,95)
HAPV3	16.432.031,63	2.797.956,21	1.420.575,78	1,40%	106.310,23	413,14	(143.370,42)
HBRH11	2.385.752,80	-	-	0,00%	-	-	-
HBSA3	362.096,90	56.019,23	33.780,90	0,03%	207.614,95	640,37	(166.504,43)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.685.660.857,49	VAR / PL:	2,754%
VAR:	101.517.607,48	ETL / PL:	3,4541%
ETL:	127.307.219,02	VAR / CDI:	9414,71%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(178.408.355,60)	BAIXA 1:	244.004.454,83	Cenário 1:	380.987.205,72
				Cenário 2:	(70.110.651,87)
				Cenário 3:	(454.024.821,82)

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
HSML11	7.770.880,74	613.649,64	(348.907,08)	-0,34%	1.062.276,57	3.882,76	(1.241.780,53)
HYPE3	3.521.668,05	311.112,58	172.019,97	0,17%	261.758,49	984,50	(326.920,59)
IFCM3	3.190.140,00	5.392,09	(1.023,50)	0,00%	-	-	-
IGTI11	442.926,40	82.130,79	48.712,90	0,05%	-	-	-
INTB3	5.509.603,80	600.054,41	235.483,48	0,23%	482.660,54	-	(594.185,08)
IRBR3	268.775,93	42.212,23	(23.667,34)	-0,02%	59.752,32	210,44	(64.169,92)
ITSA4	17.123.899,96	1.524.480,59	2.293,97	0,00%	3.295.342,83	11.754,00	(3.642.574,54)
ITUB4	32.354.831,74	3.159.127,46	1.704.933,43	1,68%	6.334.206,95	22.560,87	(6.978.883,20)
JBSS3	16.296.080,06	2.190.259,12	(1.064.529,07)	-1,05%	177.238,93	687,28	(237.797,38)
JHSF3	75.908,40	6.288,26	1.318,05	0,00%	16.465,38	58,12	(17.774,21)
JRDM11	1.019.400,00	64.845,89	(37.493,60)	-0,04%	78.218,11	293,85	(97.433,88)
KLBN11	988.641,25	80.787,60	12.706,70	0,01%	(8.045,97)	(31,50)	11.039,57
LAME4	2.365.071,96	807.506,05	121.568,88	0,12%	(342.381,76)	(1.441,48)	559.982,55
LCAM3	1.384.575,72	261.394,40	249.176,23	0,25%	150.652,62	557,64	(181.309,90)
LJQQ3	151.995,25	21.148,46	10.449,30	0,01%	106.622,06	315,28	(78.177,86)
LREN3	13.750.088,56	1.589.284,41	846.848,45	0,83%	116.667,54	452,94	(156.967,75)
LVBI11	3.369.661,46	377.739,13	(210.756,65)	-0,21%	535.546,04	1.938,27	(612.017,87)
LWSA3	3.646.316,52	1.176.077,53	(592.702,68)	-0,58%	2.040.658,11	6.323,81	(1.653.119,24)
MALL11	6.581.535,20	743.435,68	(356.557,72)	-0,35%	1.141.331,07	4.104,63	(1.285.511,69)
MATD3	2.932.065,06	1.093,62	190,95	0,00%	-	-	-
MAXR11	1.409.910,30	136.214,96	(48.996,83)	-0,05%	165.614,01	610,61	(197.507,69)
MDNE3	68.249,00	9.969,58	5.426,32	0,01%	37.348,77	116,24	(30.534,75)
MGLU3	7.399.179,84	1.629.363,39	(624.180,75)	-0,61%	5.590.653,77	16.252,77	(3.955.351,43)
MOVI3	7.828.410,00	1.405.625,52	1.257.904,90	1,24%	713.199,52	2.661,52	(874.688,52)
MRFG3	426.616,20	77.630,83	(20.953,07)	-0,02%	8.082,18	31,22	(10.742,56)
MRVE3	450.985,52	79.438,30	68.721,77	0,07%	41.059,21	153,23	(50.359,49)
MULT3	7.580.559,78	1.361.759,24	885.376,91	0,87%	(549.595,12)	(2.224,00)	816.335,52
NEWU11	600.237,00	-	-	0,00%	-	-	-
NTCO3	17.185.326,51	4.252.419,31	(2.376.040,01)	-2,34%	10.101.004,95	31.003,89	(8.016.620,25)
OMGE3	3.301.536,78	369.229,02	(117.671,22)	-0,12%	642.253,86	2.288,77	(708.478,65)
ONCO3	169.344,00	30.752,86	1.061,22	0,00%	108.630,62	-	(82.989,15)
PACUCAR_CBD ON ED	185.158,71	28.269,98	(7.846,38)	-0,01%	52.037,01	178,87	(52.914,30)
PARD3	677.659,45	126.355,88	(44.585,36)	-0,04%	83.085,77	305,62	(98.554,75)
PATC11	7.940.622,20	304.844,10	(123.813,08)	-0,12%	106.557,75	412,68	(142.543,32)
PETR3	30.836.066,56	3.785.383,87	228.401,23	0,22%	3.313.787,52	12.273,61	(3.993.802,06)
PETR4	41.549.310,95	5.547.568,13	215.011,08	0,21%	5.159.509,55	18.965,18	(6.110.095,56)
PETZ3	724.534,00	125.517,28	56.056,23	0,06%	203.709,19	700,20	(207.121,20)
POWE3	67.260,00	8.104,49	2.680,72	0,00%	2.965,84	-	(3.830,55)
PRIO3	12.095.244,24	4.508.907,13	(2.109.132,01)	-2,08%	3.040.301,88	10.578,40	(3.176.979,22)
PVBI11	460.516,23	24.440,81	(11.302,85)	-0,01%	8.266,19	-	(10.999,80)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.685.660.857,49	VAR / PL:	2,754%
VAR:	101.517.607,48	ETL / PL:	3,4541%
ETL:	127.307.219,02	VAR / CDI:	9414,71%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(178.408.355,60)	BAIXA 1:	244.004.454,83	Cenário 1:	380.987.205,72
				Cenário 2:	(70.110.651,87)
				Cenário 3:	(454.024.821,82)

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
QAGR11	8.024.062,72	581.850,80	(323.001,38)	-0,32%	653.204,90	-	(809.547,77)
QUAL3	488.592,00	59.692,86	18.063,27	0,02%	73.634,00	267,47	(84.852,11)
RADL3	7.789.506,76	1.076.069,76	450.816,07	0,44%	(454.611,25)	(1.825,98)	663.262,22
RAIL3	14.290.084,30	1.750.972,95	1.360.610,95	1,34%	1.062.206,43	3.995,05	(1.326.626,47)
RAIZ4	466.668,21	92.352,99	(26.116,68)	-0,03%	160.388,32	-	(154.302,35)
RAPT4	4.001.130,00	394.579,46	292.708,18	0,29%	546.591,19	1.997,95	(639.013,91)
RBGS11	491.728,38	44.329,35	(3.917,96)	0,00%	120.961,45	421,81	(127.033,64)
RBRL11	1.693.269,80	99.634,08	(26.175,37)	-0,03%	281.973,46	-	(319.786,45)
RCRB11	1.588.629,90	130.644,25	(67.298,44)	-0,07%	115.518,25	434,80	(144.530,05)
RDOR3	1.171.780,00	175.919,05	(54.685,85)	-0,05%	386.530,71	-	(376.347,08)
RECV3	1.229.346,00	290.225,20	122.890,26	0,12%	581.723,01	-	(503.198,87)
RENT3	6.104.263,00	1.091.181,63	1.044.165,27	1,03%	741.267,74	2.728,11	(880.354,59)
RNGO11	135.354,00	11.921,56	(6.742,19)	-0,01%	17.328,46	63,59	(20.439,15)
SANB11	593.838,40	38.245,13	7.159,77	0,01%	31.435,99	119,44	(40.200,60)
SBSP3	595.825,30	65.100,06	354,76	0,00%	83.991,43	306,42	(97.754,76)
SDIL11	348.307,05	11.504,11	6.119,89	0,01%	24.292,19	91,56	(30.492,25)
SEER3	615.517,31	84.994,95	(2.220,80)	0,00%	200.509,99	677,05	(195.928,88)
SMFT3	230.214,00	22.509,41	10.266,10	0,01%	60.448,31	-	(62.513,75)
SOMA3	3.653.355,42	455.692,23	266.774,25	0,26%	1.007.600,88	3.470,92	(1.029.479,00)
SPY	12.563.579,15	528.485,94	(280.170,02)	-0,28%	(224.753,13)	(113.072,21)	311.992,56
SQIA3	140.524,00	20.085,97	13.471,29	0,01%	31.840,95	111,94	(34.056,20)
STBP3	6.473.412,00	1.466.750,21	1.218.951,24	1,20%	3.437.833,31	10.759,31	(2.844.772,90)
SULA11	2.965.598,88	483.331,54	32.785,85	0,03%	(385.200,11)	(1.608,22)	617.218,46
SUZB3	20.135.671,99	3.076.853,18	1.638.291,14	1,61%	(519.254,44)	(2.050,85)	727.713,39
SYNE3	380.568,00	77.531,71	(28.104,94)	-0,03%	(112.435,01)	-	231.918,28
TAE11	407.328,80	23.404,28	(8.997,03)	-0,01%	14.098,51	54,04	(18.405,55)
TEND3	1.881.216,00	370.033,15	133.880,03	0,13%	(170.716,64)	(697,60)	259.616,00
TEPP11	7.089.600,00	614.519,69	(299.724,97)	-0,30%	938.571,55	3.437,24	(1.102.064,43)
TIMS3	3.009.268,50	420.339,85	350.551,79	0,35%	(338.922,29)	(1.401,53)	530.531,95
TOTS3	8.999.649,96	876.777,03	198.838,73	0,20%	297.722,24	1.142,00	(389.353,08)
TRXF11	12.743.860,50	565.951,46	(225.001,66)	-0,22%	814.865,56	3.079,82	(1.029.398,87)
UGPA3	5.013.029,01	667.519,40	506.888,12	0,50%	1.084.595,54	3.829,34	(1.171.433,38)
USIM5	7.936.711,40	1.431.362,92	458.914,83	0,45%	3.814.753,99	12.153,58	(3.280.696,99)
VALE3	52.425.657,00	5.608.983,55	371.892,80	0,37%	16.949.886,55	57.288,62	(16.598.131,02)
VBBR3	6.157.873,02	542.526,74	472.714,09	0,47%	880.281,23	-	(1.022.447,05)
VIIA3	477.588,15	81.818,26	6.415,35	0,01%	263.883,94	-	(214.895,59)
VISC11	6.242,94	405,90	(174,20)	0,00%	620,63	2,31	(754,41)
VITT3	372.775,60	3.685.949,55	(325.550,30)	-0,32%	-	-	-
VIVT3	1.142.213,68	115.945,42	44.907,99	0,04%	(209.257,93)	(900,80)	361.537,47
VTV_US	6.957.591,29	292.670,52	(155.155,51)	-0,15%	(124.466,16)	(62.618,32)	172.778,53



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.685.660.857,49	VAR / PL:	2,754%
VAR:	101.517.607,48	ETL / PL:	3,4541%
ETL:	127.307.219,02	VAR / CDI:	9414,71%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(178.408.355,60)	BAIXA 1:	244.004.454,83	Cenário 1:	380.987.205,72
				Cenário 2:	(70.110.651,87)
				Cenário 3:	(454.024.821,82)

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
VVPR11	1.339.880,00	-	-	0,00%	-	-	-
WEGE3	11.844.817,88	2.246.991,84	(1.019.679,91)	-1,00%	2.310.207,84	8.230,97	(2.547.157,08)
WEST3	54.855,00	50.311,94	28.397,10	0,03%	94.213,68	-	(40.754,88)
WSPZ21	3.266.593,71	178.556,88	(103.145,74)	-0,10%	(363.707,09)	(29.399,34)	568.351,29
XPIN11	3.502.845,78	280.630,27	(172.628,51)	-0,17%	549.325,22	-	(629.102,94)
XPPR11	3.036.706,80	338.414,00	(196.991,53)	-0,19%	524.352,70	-	(591.029,40)
YDUQ3	1.311.119,16	155.654,21	73.568,80	0,07%	313.983,55	1.097,87	(331.763,89)
INDZ21	8.974.746,00	387.957,09	164.770,55	0,16%	1.298.895,98	-	(1.505.930,56)
WINZ21	(18.981.072,00)	820.506,95	(348.480,24)	-0,34%	(2.747.090,35)	-	3.184.956,60
DI1F22	47.619.652,64	30.246,18	9.238,45	0,01%	60.258,16	(31.270,77)	(92.683,71)
DI1J22	17.423.943,14	61.233,33	26.955,30	0,03%	89.452,81	(46.225,10)	(136.620,35)
DI1N22	752.081,67	6.690,24	2.841,05	0,00%	7.306,91	(3.758,68)	(11.075,27)
DAPQ22	21.108.895,59	249.690,47	168.146,12	0,17%	99.715,50	(36.294,77)	(219.068,54)
DI1V22	911.303,57	13.196,83	6.303,65	0,01%	13.311,16	(6.818,67)	(20.036,11)
DI1F23	(35.565.094,44)	684.247,70	(351.998,43)	-0,35%	(684.390,79)	349.295,43	1.023.880,06
DAPK23	28.887.897,82	535.873,79	366.535,92	0,36%	337.274,39	(122.121,64)	(731.929,88)
DI1N23	1.589.367,23	41.657,83	25.289,41	0,02%	44.878,39	(22.750,21)	(66.389,02)
DI1F24	15.646.776,32	471.607,81	338.723,00	0,33%	575.026,30	(289.715,18)	(842.020,54)
DI1N24	828.375,73	27.805,32	21.492,45	0,02%	37.596,56	(18.824,66)	(54.487,86)
DAPQ24	26.382.707,55	640.650,25	532.027,96	0,52%	580.529,55	(208.741,03)	(1.239.451,96)
DI1F25	6.557.740,58	241.380,78	199.259,58	0,20%	356.783,39	(177.492,18)	(511.579,86)
DAPK25	9.177.398,99	242.680,35	218.457,42	0,22%	-	-	-
DI1F26	(1.472.295,26)	67.236,47	(59.790,02)	-0,06%	(106.525,24)	52.319,02	149.542,61
DAPQ26	5.032.907,86	148.597,91	141.755,75	0,14%	-	-	-
DI1F27	6.133.160,45	330.837,32	304.476,05	0,30%	558.366,33	(270.631,07)	(766.947,90)
DAPQ28	(8.291.938,63)	298.295,81	(287.718,15)	-0,28%	-	-	-
DI1F29	3.549.572,37	253.428,48	237.005,39	0,23%	457.598,97	(216.063,14)	(602.145,37)
DAPQ30	(34,76)	1,55	(1,48)	0,00%	(2,52)	0,88	4,99
DI1F31	259.508,90	23.138,35	21.356,67	0,02%	43.623,01	(20.064,18)	(55.000,18)
DAPK35	(317.074,99)	20.678,70	(19.504,50)	-0,02%	-	-	-
AUSZ21	802.032,97	41.497,71	(29.464,02)	-0,03%	7.466,55	7.286,97	(10.036,07)
DOLZ21	280.665,44	11.807,97	(6.262,60)	-0,01%	(5.033,75)	(2.519,24)	6.990,50
EUPZ21	(1.265.021,87)	32.742,28	17.785,58	0,02%	(36.242,24)	(11.488,59)	47.637,13
NZLZ21	765.092,35	40.421,18	(29.791,09)	-0,03%	(4.128,99)	6.942,76	5.646,85
SWIZ21	1.121.399,47	31.572,94	9.521,95	0,01%	8.198,16	(10.086,63)	(11.045,14)
WDOZ21	(280.665,44)	11.807,97	6.262,60	0,01%	5.033,75	2.519,24	(6.990,50)
DOLF22	(282.663,37)	11.907,11	6.371,15	0,01%	5.407,68	2.359,98	(7.584,62)
WDOF22	339.196,05	14.288,53	(7.645,39)	-0,01%	(6.489,22)	(2.831,97)	9.101,54
COMPROMISSADA	412.900.426,25	9.203,73	3.566,84	0,00%	19.261,16	(10.016,32)	(29.728,75)
EMP AÇÃO PROVISÃO	7.689,86	2,19	0,43	0,00%	4,38	(2,27)	(6,74)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.685.660.857,49	VAR / PL:	2,754%
VAR:	101.517.607,48	ETL / PL:	3,4541%
ETL:	127.307.219,02	VAR / CDI:	9414,71%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(178.408.355,60)	BAIXA 1:	244.004.454,83	Cenário 1:	380.987.205,72
				Cenário 2:	(70.110.651,87)
				Cenário 3:	(454.024.821,82)

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
DE252 AEGEA SA CDI -	1.068.194,82	99,57	73,82	0,00%	134,00	(68,62)	(201,67)
DE252 AERIS CDI - AERI11	1.276.056,81	1.602,06	1.129,71	0,00%	2.040,54	(1.027,98)	(2.987,86)
DE252 ALIANSCE CDI -	4.005.921,73	40.648,12	37.413,37	0,04%	66.424,83	(32.372,31)	(92.050,50)
DE252 AMPL CDI - AMPLAO	2.077.421,77	3.786,39	(2.454,26)	0,00%	(4.368,12)	2.222,14	6.499,96
DE252 AUTOBAN CDI -	921.690,95	414,25	315,97	0,00%	559,57	(281,10)	(815,60)
DE252 AUTOPIST CDI -	1.526.447,90	726,70	585,27	0,00%	1.031,38	(514,88)	(1.487,81)
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.721.548,60	472,08	323,17	0,00%	586,51	(298,25)	(872,28)
DE252 BCBF CDI - BCBF14	270.412,66	265,75	183,66	0,00%	333,72	(168,49)	(490,45)
DE252 BCBF CDI - BCBF15	2.608.263,00	2.782,05	1.926,65	0,00%	3.493,53	(1.762,24)	(5.126,41)
DE252 BKBR CDI - BKBR18	1.451.131,59	762,53	523,19	0,00%	929,65	(470,72)	(1.372,72)
DE252 BRKA CDI - BRKP18	2.665.836,01	4.647,13	3.252,81	0,00%	5.871,47	(2.959,91)	(8.606,71)
DE252 BRML CDI - BRML17	3.185.890,54	6.679,18	(5.529,84)	-0,01%	(9.813,18)	4.909,76	14.205,50
DE252 CCPR CDI - CCPRA3	2.152.185,08	3.267,41	(1.149,31)	0,00%	(3.197,16)	1.471,22	4.012,74
DE252 CEA MODA CDI -	2.109.686,72	1.862,55	1.266,40	0,00%	2.287,86	(1.156,00)	(3.366,49)
DE252 CELPA CDI - CELP15	2.556.391,44	197,88	149,39	0,00%	274,59	(140,85)	(414,45)
DE252 CONT GLO CDI -	2.397.831,09	4.653,72	3.963,55	0,00%	7.131,31	(3.512,28)	(10.061,25)
DE252 COPEL GT CDI -	297.740,08	1.252,84	(708,40)	0,00%	(1.346,57)	690,54	2.030,67
DE252 COPEL GT CDI -	296.076,81	647,35	(451,15)	0,00%	(793,55)	402,21	1.173,65
DE252 CORSAN CDI -	1.606.303,92	23.624,35	20.362,61	0,02%	35.392,64	(17.603,08)	(50.701,25)
DE252 COSAN LO CDI -	1.649.819,51	1.461,48	1.008,01	0,00%	1.834,43	(926,71)	(2.698,44)
DE252 CSAN CDI - CSAN23	1.141.663,57	4.221,54	3.829,59	0,00%	7.057,53	(3.413,62)	(9.666,77)
DE252 DASA CDI - DASAA2	2.640.952,71	966,13	651,50	0,00%	1.168,83	(592,66)	(1.730,03)
DE252 ECORODOV CDI -	1.803.384,85	29.693,57	27.851,12	0,03%	50.761,67	(24.208,71)	(67.900,21)
DE252 ECORODOV CDI -	2.175.798,11	872,22	484,67	0,00%	992,13	(507,93)	(1.492,11)
DE252 ELEKTRO CDI -	553.888,05	1.475,94	(827,55)	0,00%	(1.513,62)	774,52	2.274,26
DE252 ELETROB CDI -	2.080.001,54	2.800,70	2.159,38	0,00%	3.848,28	(1.925,55)	(5.571,83)
DE252 ENER TR CDI -	7.458.965,06	165.940,68	148.332,05	0,15%	275.297,82	(132.717,96)	(375.150,62)
DE252 ENERSUL CDI -	1.000.492,20	1.044,64	(463,09)	0,00%	(1.019,89)	528,66	1.565,64
DE252 EQUATENE CDI -	1.458.679,98	716,81	492,78	0,00%	874,98	(443,18)	(1.292,74)
DE252 GUAR CDI - GUAR24	2.702.405,26	3.667,81	2.497,51	0,00%	4.541,64	(2.291,51)	(6.667,04)
DE252 GUARIROB CDI -	1.082.907,61	598,06	468,97	0,00%	823,79	(412,65)	(1.194,99)
DE252 IGUATEMI CDI -	2.324.672,19	667,73	366,77	0,00%	763,43	(391,19)	(1.149,89)
DE252 IGUATEMI CDI -	2.126.352,63	5.069,03	(3.999,34)	0,00%	(7.099,64)	3.572,19	10.373,59
DE252 INTERVIA CDI -	1.306.959,37	724,28	504,62	0,00%	901,71	(455,66)	(1.327,08)
DE252 LIGHT CDI - LIGHD3	1.644.016,00	4.070,91	3.494,71	0,00%	6.265,19	(3.084,81)	(8.834,30)
DE252 LOCALIZA CDI -	1.162.846,07	158,30	(37,11)	0,00%	(215,22)	111,75	331,25
DE252 LOCAMERI CDI -	1.982.820,96	2.612,12	1.899,82	0,00%	3.398,75	(1.708,94)	(4.960,82)
DE252 MOV_PART CDI -	1.101.513,83	1.775,45	1.342,50	0,00%	2.425,70	(1.213,99)	(3.513,53)
DE252 MOV_PART CDI -	1.199.670,68	4.547,58	3.958,68	0,00%	7.142,40	(3.503,17)	(10.007,95)
DE252 MOV_PART CDI -	1.442.937,67	71,73	16,94	0,00%	0,04	-	(0,06)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.685.660.857,49	VAR / PL:	2,754%
VAR:	101.517.607,48	ETL / PL:	3,4541%
ETL:	127.307.219,02	VAR / CDI:	9414,71%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(178.408.355,60)	BAIXA 1:	244.004.454,83	Cenário 1:	380.987.205,72
				Cenário 2:	(70.110.651,87)
				Cenário 3:	(454.024.821,82)

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
DE252 MULTIPLA CDI -	3.116.119,74	5.945,04	(4.416,41)	0,00%	(7.683,46)	3.883,57	11.311,54
DE252 OMEGA GE CDI -	3.300.800,56	6.684,26	5.723,77	0,01%	10.284,09	(5.063,48)	(14.501,45)
DE252 OURO VER CDI -	1.577.236,89	2.437,10	1.828,45	0,00%	3.277,67	(1.642,65)	(4.758,16)
DE252 PROLAGOS CDI -	3.239.241,72	51.417,48	(36.550,61)	-0,04%	(62.113,11)	31.351,53	91.230,31
DE252 RD COLIN CDI -	3.254.689,09	49.529,35	43.606,41	0,04%	76.471,96	(38.018,31)	(109.411,22)
DE252 RENNEN CDI -	1.408.326,34	784,15	536,58	0,00%	965,75	(488,95)	(1.425,82)
DE252 RT BANDE CDI -	3.435.572,34	4.631,92	3.624,21	0,00%	6.476,48	(3.233,12)	(9.341,80)
DE252 S LUIZ A CDI -	1.128.981,45	4.006,14	3.635,50	0,00%	6.700,36	(3.240,58)	(9.176,28)
DE252 SABESP CDI -	1.199.148,16	597,84	484,70	0,00%	850,96	(424,67)	(1.226,81)
DE252 SANEAMEN CDI -	2.609.181,28	2.333,09	1.610,34	0,00%	2.925,97	(1.477,18)	(4.299,53)
DE252 SBF COME CDI -	4.134.967,72	57.006,91	45.731,29	0,05%	79.195,58	(39.875,99)	(115.743,08)
DE252 SIMPAR CDI -	1.207.068,10	6.720,52	6.028,15	0,01%	11.032,10	(5.358,54)	(15.214,44)
DE252 SUL AME CDI -	658.100,75	817,98	(377,66)	0,00%	(787,23)	405,58	1.196,30
DE252 TELEF BR CDI -	5.037.293,33	62.462,86	31.521,08	0,03%	50.541,13	(26.471,96)	(78.810,85)
DE252 USIMINAS CDI -	3.376.435,68	21.483,68	12.933,57	0,01%	21.714,73	(11.109,16)	(32.602,89)
DE252 VAMOS CDI -	1.105.578,59	1.283,57	961,98	0,00%	1.719,47	(862,64)	(2.500,52)
DE252 VAMOS CDI -	299.358,99	1.419,42	1.281,91	0,00%	2.359,94	(1.142,82)	(3.238,64)
DE252 VIX LOGI CDI -	1.068.014,31	1.319,71	949,46	0,00%	1.710,59	(860,80)	(2.500,15)
LF selic	8.122.139,98	11.880,54	(8.911,21)	-0,01%	(15.314,97)	7.975,65	23.694,83
LF252 ABC CDI -	1.042.285,44	51,82	12,24	0,00%	0,03	0,00	(0,04)
LF252 ABC CDI -	1.042.285,44	51,82	12,24	0,00%	0,03	0,00	(0,04)
LF252 B.ALFA CDI -	1.014.340,68	50,43	11,91	0,00%	0,03	-	(0,04)
LF252 CNH CDI -	1.940.858,57	96,49	22,79	0,00%	0,06	0,00	(0,08)
LF252 DAYCOVAL CDI -	1.208.016,10	60,05	14,18	0,00%	0,04	-	(0,05)
LF252 DAYCOVAL CDI -	2.200.690,46	109,40	25,84	0,00%	0,07	-	(0,09)
LF252 PANAMERI CDI -	1.040.395,55	51,72	12,22	0,00%	0,03	-	(0,04)
LF252 PARANA B CDI -	1.571.773,08	78,14	18,45	0,00%	0,05	-	(0,06)
LFSN BRADESCO CDI -	3.425.322,37	170,28	40,22	0,00%	0,10	0,00	(0,14)
LFT	39.017.331,37	20.603,54	(13.455,02)	-0,01%	1,16	0,00	(1,57)
LFV TOYOTA CDI -	2.256.151,94	112,16	26,49	0,00%	0,07	-	(0,09)
CMTR33	5.409.167,51	30.536,11	18.394,09	0,02%	(2.722,34)	1.001,89	6.138,82
CRI RB CAPIT IPCA M D -	7.867.436,11	160.371,46	141.024,54	0,14%	165.313,32	(58.644,14)	(331.425,80)
DE252 AEGEA SA IPCA -	11.978.532,61	271.057,29	229.413,50	0,23%	255.894,99	(91.976,85)	(526.187,41)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.658.191,19	98.785,41	78.217,91	0,08%	82.746,64	(29.554,60)	(172.633,92)
DE252 CEMIG - IPCA	2.574.383,72	41.610,65	34.083,99	0,03%	31.686,54	(11.406,17)	(67.829,19)
DE252 COMGAS IGPM-100 -	36.668.909,82	992.441,25	937.637,65	0,92%	1.351.536,28	(26.277,27)	(2.653.715,91)
DE252 CSAN IPCA -	5.555.264,35	172.492,31	166.680,37	0,16%	263.954,26	(89.845,00)	(490.563,01)
DE252 CSMG IPCA -	13.104.823,07	255.327,89	206.756,40	0,20%	210.202,15	(75.317,70)	(436.070,25)
DE252 DUKE GEP - IPCA	14.126.088,91	204.865,28	140.257,56	0,14%	114.206,40	(41.386,02)	(248.321,78)
DE252 ECORODOV IPCA -	10.461.547,15	231.113,12	193.511,14	0,19%	215.344,19	(77.600,04)	(442.431,44)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.685.660.857,49	VAR / PL:	2,754%
VAR:	101.517.607,48	ETL / PL:	3,4541%
ETL:	127.307.219,02	VAR / CDI:	9414,71%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(178.408.355,60)	BAIXA 1:	244.004.454,83	Cenário 1:	380.987.205,72
				Cenário 2:	(70.110.651,87)
				Cenário 3:	(454.024.821,82)

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
DE252 ECORODOV IPCA -	3.105.460,79	65.856,94	52.145,27	0,05%	55.164,43	(19.703,07)	(115.089,28)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	3.061.653,80	27.418,50	21.360,39	0,02%	7.477,82	(2.702,21)	(16.149,55)
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	462.735,35	3.448,73	1.592,78	0,00%	306,84	(112,38)	(684,04)
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	610.446,51	6.441,00	4.047,66	0,00%	2.173,22	(792,05)	(4.789,16)
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	1.005.270,24	14.180,12	10.199,96	0,01%	6.846,38	(2.487,24)	(14.974,24)
DE252 IMED - IPCA	1.035.074,68	8.483,50	4.155,45	0,00%	1.504,05	(550,13)	(3.342,36)
DE252 IRB IPCA - IRBR12	13.735.297,74	332.751,28	306.209,65	0,30%	390.212,04	(138.903,79)	(774.700,91)
DE252 LIGHT IPCA - LIGHD7	4.684.070,56	122.915,62	112.844,97	0,11%	139.589,89	(48.946,43)	(283.577,84)
DE252 LIGHT IPCA -	4.384.407,94	54.733,83	35.090,84	0,03%	26.933,24	(9.690,23)	(57.944,24)
DE252 LOCALIZA IPCA -	8.700.061,84	277.395,74	268.363,03	0,26%	429.286,05	(144.666,28)	(797.969,94)
DE252 LOCAMERI IPCA -	10.138.478,60	322.117,39	311.751,70	0,31%	500.569,94	(173.581,28)	(917.950,26)
DE252 MOV_PART IPCA -	2.988.414,43	95.410,77	92.390,87	0,09%	149.573,44	(53.153,83)	(269.905,82)
DE252 MOVIDA L IPCA -	6.043.080,45	218.298,74	209.839,12	0,21%	329.785,45	(116.052,97)	(669.695,58)
DE252 PETR IPCA - PETR45	14.018.519,59	284.117,93	218.575,20	0,22%	223.398,69	(79.986,12)	(471.902,33)
DE252 RD COLIN - IPCA	8.387.529,88	79.867,08	50.535,61	0,05%	50.907,46	(20.962,12)	(98.914,60)
DE252 SABESP - IPCA	10.288.031,04	107.923,12	83.719,80	0,08%	41.265,58	(14.939,54)	(89.516,47)
DE252 SABESP IPCA -	14.156.529,02	286.232,81	237.064,67	0,23%	248.882,52	(88.947,35)	(518.242,65)
DE252 SIMPAR IPCA M D -	920.018,62	29.592,30	28.658,93	0,03%	46.524,83	(16.640,82)	(83.588,76)
DE252 TRANS AL - IPCA	11.256.703,12	216.574,13	170.448,77	0,17%	164.413,70	(59.290,24)	(353.434,82)
DE252 VAMOS IPCA -	6.097.690,14	185.170,89	178.951,38	0,18%	284.732,95	(98.542,29)	(525.827,97)
DE252 VAMOS IPCA -	2.341.769,56	77.051,45	74.623,45	0,07%	121.323,07	(43.146,94)	(218.468,96)
DEBI AESTUCAN IPCA -	4.877.508,04	192.198,13	186.371,33	0,18%	311.827,41	(104.519,43)	(545.631,36)
DEBI ANEMUS IPCA -	12.819.442,29	456.371,82	442.529,65	0,44%	730.047,63	(254.188,83)	(1.267.209,23)
DEBI ANET IPCA - ANET11	5.499.627,47	129.240,38	117.545,34	0,12%	150.042,95	(52.379,05)	(298.899,22)
DEBI B2W IPCA - BTOW15	9.021.415,08	280.811,00	272.086,52	0,27%	439.899,63	(153.992,04)	(798.607,62)
DEBI BRISANET IPCA -	5.528.795,51	140.069,61	129.705,05	0,13%	168.535,45	(59.028,72)	(334.996,52)
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	7.013.342,65	231.883,68	223.691,49	0,22%	363.986,11	(117.281,69)	(680.096,80)
DEBI CAGECE IPCA -	4.863.606,62	98.892,33	89.382,13	0,09%	114.891,80	(27.374,12)	(277.604,22)
DEBI CART IPCA - CART13	4.530.366,35	148.146,68	143.513,59	0,14%	231.000,96	(80.318,92)	(416.231,14)
DEBI CEEE D IPCA - CEED21	4.116.042,58	118.664,77	113.605,59	0,11%	171.560,43	(58.607,45)	(328.512,24)
DEBI CELP IPCA - CEPEC1	2.153.047,80	69.681,19	67.399,61	0,07%	107.994,15	(36.837,09)	(199.813,23)
DEBI COELBA IPCA -	2.147.165,03	69.466,72	67.187,97	0,07%	107.605,85	(36.653,29)	(199.269,52)
DEBI COMGAS IPCA -	3.293.224,12	103.994,45	100.389,31	0,10%	157.846,23	(52.855,10)	(297.283,07)
DEBI CORSAN IPCA -	5.648.994,03	152.719,89	144.961,55	0,14%	203.943,55	(69.038,26)	(398.197,16)
DEBI CTEEP IPCA - CTEE29	889.613,18	31.428,67	30.330,89	0,03%	50.290,25	(16.281,06)	(87.940,57)
DEBI ECHOENER IPCA -	1.334.211,09	48.758,83	47.093,49	0,05%	79.583,64	(32.155,92)	(127.162,36)
DEBI ECHOENER IPCA -	1.705.887,74	42.403,69	39.630,15	0,04%	53.869,92	(18.322,24)	(106.413,61)
DEBI EDPM IPCA - MGSP12	1.980.910,00	58.110,62	55.868,90	0,06%	86.386,49	(27.535,70)	(159.028,41)
DEBI ELEKTRO IPCA -	2.141.269,80	69.251,91	66.975,88	0,07%	107.216,74	(36.469,12)	(198.724,69)
DEBI ELETROB IPCA -	11.086.638,98	317.717,98	302.210,01	0,30%	441.250,97	(150.806,31)	(858.942,17)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.685.660.857,49	VAR / PL:	2,754%
VAR:	101.517.607,48	ETL / PL:	3,4541%
ETL:	127.307.219,02	VAR / CDI:	9414,71%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(178.408.355,60)	BAIXA 1:	244.004.454,83	Cenário 1:	380.987.205,72
				Cenário 2:	(70.110.651,87)
				Cenário 3:	(454.024.821,82)

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
DEBI ENERGISA IPCA -	3.047.471,29	98.765,70	95.554,07	0,09%	153.383,56	(52.609,33)	(282.807,38)
DEBI ENERGMIR IPCA -	1.021.892,34	22.222,15	19.747,62	0,02%	23.782,19	(8.464,84)	(47.807,23)
DEBI ENSINOP IPCA -	1.905.308,71	51.048,23	48.683,98	0,05%	73.215,89	(26.262,47)	(135.020,58)
DEBI ENTREVIA IPCA -	26.907.575,27	723.433,06	693.468,52	0,68%	1.054.349,96	(377.280,46)	(1.968.740,06)
DEBI HIDRO BR IPCA -	4.195.008,85	137.062,54	132.618,78	0,13%	212.999,13	(72.976,15)	(392.988,81)
DEBI HOLDARAG IPCA -	7.394.212,63	259.992,09	252.178,68	0,25%	414.857,62	(142.603,24)	(731.183,75)
DEBI IGUA SAN IPCA -	8.827.167,60	261.733,22	252.430,59	0,25%	388.689,72	(133.239,46)	(715.827,50)
DEBI JAGUARA IPCA -	1.692.645,82	35.658,97	31.481,69	0,03%	37.416,57	(13.323,80)	(75.376,89)
DEBI LAME IPCA - LAMEA6	8.699.319,94	282.884,20	273.928,92	0,27%	443.528,99	(156.838,97)	(802.344,45)
DEBI METRORIO IPCA -	10.233.271,00	302.838,62	287.005,11	0,28%	424.300,71	(150.222,30)	(802.283,21)
DEBI MG050 IPCA -	4.526.673,51	116.417,02	110.105,85	0,11%	157.208,35	(54.523,95)	(301.556,29)
DEBI NEOENERG IPCA -	5.940.446,89	164.850,23	156.736,33	0,15%	226.383,07	(75.585,30)	(448.789,73)
DEBI NORTE EN IPCA -	7.816.066,71	217.955,75	205.466,82	0,20%	295.694,92	(105.302,09)	(563.160,25)
DEBI PAMPASUL IPCA -	1.188.042,05	28.082,54	25.489,61	0,03%	32.649,55	(11.522,97)	(64.718,88)
DEBI PAMPASUL IPCA -	3.517.895,58	128.297,42	124.678,80	0,12%	211.785,17	(74.250,20)	(365.558,57)
DEBI PAMPASUL IPCA -	2.463.993,57	81.143,66	78.595,87	0,08%	127.174,58	(43.061,23)	(233.657,83)
DEBI PARANAGU IPCA -	720.672,76	15.940,92	14.699,09	0,01%	19.012,93	(6.656,19)	(37.124,24)
DEBI QUATA IPCA -	4.127.111,86	103.555,13	92.936,62	0,09%	112.548,28	(40.446,53)	(225.438,06)
DEBI RIO PR IPCA - RIPR22	533.025,50	15.955,68	15.384,94	0,02%	24.080,99	(7.946,62)	(45.801,21)
DEBI TAUBATE IPCA -	9.471.956,31	285.132,98	274.235,38	0,27%	421.743,68	(139.255,23)	(777.115,01)
DEBI TUCANOHO IPCA -	3.451.341,16	135.485,61	131.528,25	0,13%	218.293,75	(74.415,73)	(381.548,18)
DEBI UTE GNA IPCA -	4.254.142,41	168.518,00	162.794,98	0,16%	277.309,78	(92.247,74)	(480.750,95)
DEBI VENSJOR IPCA -	1.328.492,69	30.226,88	27.505,60	0,03%	35.959,23	(13.156,44)	(69.216,00)
DEBI VIARONDO IPCA -	7.986.346,16	240.237,73	232.222,35	0,23%	365.277,02	(123.077,32)	(675.125,43)
ECCR32	3.290.147,30	46.410,09	33.383,44	0,03%	22.407,52	(8.140,50)	(49.009,17)
LF ipca	1.345.381,75	12.511,82	9.593,73	0,01%	10.605,61	(3.848,65)	(23.135,77)
LFS ITAU IPCA -	5.151.212,58	61.790,35	41.890,70	0,04%	25.128,44	(9.144,93)	(55.185,75)
LFS ITAU IPCA M D-	807.076,26	12.011,98	8.762,18	0,01%	6.067,14	(2.202,86)	(13.251,67)
LFS ITAU IPCA M D-	4.035.381,30	60.059,88	43.810,92	0,04%	30.335,69	(11.014,29)	(66.258,33)
LFS ITAU IPCA M D-	9.684.915,13	144.143,70	105.146,22	0,10%	72.805,65	(26.434,30)	(159.020,00)
LFS ITAU IPCA M D-	7.263.686,34	108.107,78	78.859,66	0,08%	54.604,24	(19.825,73)	(119.265,00)
LFS ITAU IPCA M D-	5.649.533,82	84.083,83	61.335,29	0,06%	42.469,96	(15.420,01)	(92.761,67)
LFS ITAU IPCA M D-	8.086.185,80	122.594,79	89.816,12	0,09%	62.782,24	(22.790,33)	(137.061,37)
LFSN BRADESCO IPCA -	12.013.079,00	316.493,32	276.859,11	0,27%	308.582,49	(110.685,37)	(655.074,03)
LFSN BRADESCO IPCA M D-	3.884.026,81	109.745,65	99.824,63	0,10%	116.001,38	(41.493,03)	(244.662,21)
NTNB	1.796.771.998,79	81.590.331,92	77.287.760,34	76,13%	195.531.683,86	(63.077.632,35)	(328.065.172,40)
IDIJQF5	(0,17)	2,75	(0,50)	0,00%	(10.546.331,24)	0,18	0,18
IDIJQF6	0,55	8,64	1,58	0,00%	11.241.638,53	(0,58)	(0,58)
IDIJQFM	19.509,81	129.228,14	23.664,60	0,02%	(1.055.040,75)	(19.921,71)	(19.987,08)
IDIJQFN	(32.851,56)	187.807,78	(34.396,06)	-0,03%	1.089.873,10	33.319,82	33.543,99



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.685.660.857,49	VAR / PL:	2,754%
VAR:	101.517.607,48	ETL / PL:	3,4541%
ETL:	127.307.219,02	VAR / CDI:	9414,71%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(178.408.355,60)	BAIXA 1:	244.004.454,83	Cenário 1:	380.987.205,72
				Cenário 2:	(70.110.651,87)
				Cenário 3:	(454.024.821,82)

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
AB AMERICAN GROWTH	9.894.751,19	635.674,32	(219.012,45)	-0,22%	2.117.384,40	(89.052,76)	2.247.855,37
BR ELETRO FIDC S1	12.315,39	76.807,90	(38.211,92)	-0,04%	(2.152.087,40)	-	(12.315,29)
FARM SYN AGRO FIDC	3.206.256,91	6.537,58	5.283,02	0,01%	(1.383.780,78)	-	4.791,25
FIDC CELG DIST SN B	3.432.880,48	54.832,21	(4.085,70)	0,00%	67.669.765,96	926,51	(308.174,91)
FIDC CREDZ MZ4	1.050.411,62	6.204,02	4.965,30	0,00%	(3.521,26)	-	(81.384,12)
FIDC VERDECARD SN4	7.509.831,35	294,07	(117,49)	0,00%	246.032,18	-	(84.754,26)
FII HSI LOGISTICA	1.011.776,70	74.340,90	(50.228,21)	-0,05%	64.223,94	-	(181.380,59)
FII VIA PQ SHOPPING	1.964.779,90	-	-	0,00%	62.987,10	-	-
FUNDSMITH EQ FUND	10.835.864,77	538.026,65	(322.387,32)	-0,32%	158.324,87	(97.522,78)	1.353.896,39
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.472.638,81	59.141,40	(14.856,83)	-0,01%	-	-	-
LOOMIS US GROWTH	8.103.303,28	531.592,32	(296.641,71)	-0,29%	(899.298,50)	(72.929,73)	1.495.111,35
MFS MERIDIAN EUROPEA	6.914.159,20	476.949,96	(417.525,52)	-0,41%	-	(62.227,43)	557.873,81
PICTET GL FIC FIM IE	3.780.388,53	34.993,88	(8.995,76)	-0,01%	(949.340,89)	-	-
RB CAP CREDIT AL SN4	509.089,94	2.826,95	1.527,47	0,00%	(383.751,11)	-	15.732,80
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	2.786.952,57	32.249,49	21.439,48	0,02%	-	-	(468.201,05)
WELLINGTON GLO QUAL	10.822.570,15	561.425,11	(406.449,79)	-0,40%	(11.275,57)	(97.403,13)	1.668.392,85
Total	3.906.137.127,03	205.957.484,53	101.517.607,48	1,00	380.987.205,72	(70.110.651,87)	(454.024.821,82)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV RENDA FIXA CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	2.018.457.032,90	VAR / PL:	4,663%
VAR:	94.111.091,15	ETL / PL:	5,8470%
ETL:	118.019.145,55	VAR / CDI:	15936,84%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(172.539.435,87)	BAIXA 1:	225.251.133,20	Cenário 1:	175.372.966,32
				Cenário 2:	(63.452.407,10)
				Cenário 3:	(302.371.858,24)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	6.000,00	9,34	(6,27)	0,00%	(62,63)	(0,25)	86,17
RECEBER	(82.333,76)	128,15	86,10	0,00%	859,43	3,37	(1.182,43)
COMPROMISSADA	124.135.941,63	193.545,09	(128.367,69)	-0,14%	(1.290.002,80)	(8.079,78)	1.773.852,46
CMTR33	5.413.512,70	26.883,69	13.503,59	0,01%	(59.275,40)	796,73	83.982,13
17H0164854	7.878.811,07	177.444,93	149.580,83	0,16%	81.924,62	(58.687,36)	(216.012,51)
AEGP23	11.993.799,70	299.610,42	241.141,61	0,26%	128.839,33	(91.930,08)	(350.169,64)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.660.848,03	108.201,28	80.423,26	0,09%	33.740,60	(29.644,14)	(104.971,63)
CMDT33	2.576.104,68	44.783,69	34.320,17	0,04%	4.621,02	(11.450,30)	(30.482,76)
GASP17	36.747.914,11	1.209.283,40	1.175.373,62	1,25%	967.188,13	(33.372,59)	(2.127.340,70)
CSMGC3	13.112.809,90	277.812,05	211.030,10	0,22%	72.439,63	(75.611,71)	(245.969,85)
GEPA24	14.125.262,07	215.670,65	129.345,13	0,14%	(32.870,25)	(42.094,01)	(46.219,70)
ERDV17	10.474.146,46	254.870,35	202.383,22	0,22%	104.507,83	(77.595,80)	(288.960,14)
ERDV36	3.107.232,02	72.134,19	53.615,51	0,06%	22.493,73	(19.762,76)	(69.981,09)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	3.061.918,34	26.910,63	18.808,59	0,02%	(24.433,01)	(2.845,95)	27.711,40
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	462.981,10	3.555,10	922,86	0,00%	(4.539,31)	(126,42)	5.994,78
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	610.631,91	6.622,33	3.339,02	0,00%	(4.211,49)	(813,15)	4.003,68
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	1.005.523,74	14.735,26	9.483,00	0,01%	(3.668,65)	(2.521,53)	(492,87)
SULM23	1.035.634,22	8.769,37	2.622,94	0,00%	(9.330,10)	(583,80)	11.583,38
DE252 PETR IPCA - PETR45	14.022.755,45	309.445,06	221.659,83	0,24%	76.386,73	(80.377,37)	(269.197,74)
RDCO34	8.387.096,85	84.033,81	41.063,30	0,04%	(36.444,33)	(21.381,92)	21.190,78
SBESC7	10.288.207,95	109.028,22	75.835,72	0,08%	(65.963,32)	(15.419,81)	57.877,19
SBSPC2	14.169.448,18	313.767,86	245.639,69	0,26%	99.483,72	(89.083,37)	(311.686,20)
TAEE33	11.262.421,24	234.936,66	172.343,25	0,18%	46.080,81	(59.479,90)	(190.132,06)
ELET42	11.121.213,10	361.391,52	341.443,50	0,36%	322.262,48	(150.689,17)	(693.810,57)
ENMI21	1.023.691,35	24.750,50	21.156,53	0,02%	12.913,55	(8.459,92)	(32.743,13)
ENTV12	26.988.958,67	820.568,47	778.250,28	0,83%	766.582,43	(377.089,40)	(1.570.590,14)
IGSN15	2.286.223,27	76.606,42	73.559,70	0,08%	76.164,90	(34.479,93)	(151.453,11)
ENJG21	1.695.444,87	39.613,05	33.556,92	0,04%	19.437,23	(13.320,72)	(50.468,93)
NEOE16	5.958.455,25	186.804,54	177.149,14	0,19%	162.657,12	(75.527,03)	(360.330,43)
ECCR32	3.290.977,00	48.227,00	31.036,91	0,03%	(12.007,11)	(8.252,73)	(1.613,12)
LFS0120016V	5.149.459,62	63.677,80	36.873,67	0,04%	(28.716,78)	(9.321,85)	18.969,28
LFS012001GU	807.125,53	12.518,34	8.259,11	0,01%	(2.373,41)	(2.230,31)	(1.627,24)
LFS012001GZ	4.035.627,64	62.591,72	41.295,53	0,04%	(11.867,07)	(11.151,56)	(8.136,22)
LFS012001H2	9.685.506,33	150.220,12	99.109,27	0,11%	(28.480,96)	(26.763,74)	(19.526,93)
LFS012001H4	7.264.129,75	112.665,09	74.331,95	0,08%	(21.360,72)	(20.072,81)	(14.645,20)
LFS012001H6	5.649.878,69	87.628,40	57.813,74	0,06%	(16.613,89)	(15.612,18)	(11.390,71)
LFS012001IP	8.087.502,17	127.916,04	85.047,64	0,09%	(21.793,82)	(23.065,22)	(20.582,23)
LFSN16000GM	12.034.816,93	353.326,55	297.296,35	0,32%	179.899,52	(110.108,97)	(476.136,72)
LFSN1800DC5	3.893.147,76	122.563,44	108.537,91	0,12%	74.078,74	(41.206,57)	(186.230,35)
NTNB	1.692.540.136,05	88.947.058,99	88.892.225,63	94,45%	173.794.419,82	(61.804.993,11)	(296.525.025,13)
Total	2.099.968.961,57	95.590.309,52	94.111.091,15	100,00%	175.372.966,32	(63.452.407,10)	(302.371.858,24)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	677.537.999,87	VAR / PL:	3,980%
VAR:	26.967.724,81	ETL / PL:	4,9914%
ETL:	33.818.626,48	VAR / CDI:	13604,78%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.251,76)	BAIXA 1:	1.426,59	Cenário 1:	92.281.257,86
				Cenário 2:	281.395,39
				Cenário 3:	(86.076.353,55)

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	1.926.000,08	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	1.638.107,51	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	21.619.490,22	3.799.490,20	(1.032.314,60)	-3,83%	(4.591.926,43)	(20.115,14)	8.286.188,52
ALPA4	332.773,17	48.079,02	16.972,43	0,06%	106.306,52	359,85	(104.453,35)
ALSO3	1.539.944,00	251.896,80	71.064,55	0,26%	115.621,01	434,71	(144.284,86)
AMER3	3.062.047,12	645.244,14	46.803,83	0,17%	223.365,78	-	(279.392,29)
ANIM3	69.336,00	16.759,55	11.441,11	0,04%	37.863,62	117,88	(30.982,21)
ASAI3	4.339.054,50	909.671,15	318.117,53	1,18%	1.888.412,56	-	(1.683.460,56)
AZUL4	391.240,92	75.451,36	46.515,21	0,17%	206.594,12	647,25	(171.343,28)
B3SA3	21.915.274,94	1.933.849,10	(30.317,10)	-0,11%	1.212.135,26	4.600,12	(1.545.991,17)
UNT	17.836.545,43	1.675.264,68	1.137.321,63	4,22%	4.243.552,58	14.847,59	(4.490.455,07)
BBAS3	15.565.397,93	1.587.491,22	1.023.956,89	3,80%	752.191,57	2.864,15	(966.887,62)
BBDC3	1.200.846,10	97.277,36	22.229,46	0,08%	61.889,57	235,30	(79.268,70)
BBDC4	29.583.333,25	2.485.744,92	444.873,19	1,65%	1.764.977,84	6.684,35	(2.240.240,25)
BBRK3	19.398,00	3.983,31	1.376,67	0,01%	10.869,07	33,67	(8.800,60)
BBSE3	1.343.481,84	167.906,46	(51.237,37)	-0,19%	(168.085,24)	(699,89)	267.580,37
BEEF3	106.383,42	19.120,46	9.958,19	0,04%	17.139,27	61,97	(19.543,71)
BIDI11	4.614.397,72	926.885,58	301.401,24	1,12%	1.371.936,56	4.685,12	(1.374.755,73)
BIDI3	938,96	-	-	0,00%	-	-	-
BIDI4	127.530,40	22.902,08	8.766,03	0,03%	39.740,86	134,94	(39.318,92)
BMGB4	173.978,00	19.621,73	13.920,99	0,05%	66.486,02	219,66	(61.907,00)
BPAN4	2.468.304,60	454.155,64	293.092,83	1,09%	1.549.923,52	4.693,87	(1.195.367,20)
BRAP4	1.225.690,75	122.770,06	57.042,68	0,21%	279.200,40	981,03	(298.284,20)
BRFS3	820.869,25	117.135,51	61.901,75	0,23%	199.631,44	696,95	(210.202,02)
BRKM5	674.273,60	121.876,19	54.896,47	0,20%	218.461,29	738,18	(213.799,80)
BRML3	8.944.443,20	1.769.015,74	393.918,54	1,46%	61.744,65	239,90	(83.226,83)
CASH3	83.005,39	26.389,60	5.555,53	0,02%	66.049,87	-	(45.541,02)
CCRO3	702.236,26	56.104,38	27.973,64	0,10%	48.076,56	181,32	(60.432,11)
CESP6	8.088.550,68	749.202,69	(220.008,92)	-0,82%	(720.472,84)	(2.941,40)	1.093.264,50
CIEL3	2.596.541,76	352.293,20	32.600,02	0,12%	357.926,29	1.307,60	(417.914,95)
CLSA3	3.051.815,00	128.915,12	20.427,35	0,08%	-	-	-
CMIG4	748.743,48	104.174,73	73.024,03	0,27%	99.640,25	364,79	(116.913,57)
COGN3	234.020,24	24.665,89	14.106,53	0,05%	50.115,16	177,11	(54.242,30)
CPFE3	7.366.075,20	628.278,20	245.736,41	0,91%	6.437,71	25,09	(8.739,19)
CPL6	491.064,92	59.339,11	38.385,17	0,14%	70.622,22	257,32	(81.955,40)
CRFB3	2.231.281,50	125.747,62	80.952,02	0,30%	308.384,03	1.126,42	(359.935,33)
CSAN3	1.274.298,75	148.381,33	86.355,53	0,32%	227.401,48	816,02	(254.849,83)
CSED3	2.508.350,00	580.196,54	218.838,68	0,81%	739.917,04	-	(742.990,07)
CSNA3	715.577,60	85.889,13	41.051,31	0,15%	367.295,73	1.156,70	(308.044,96)
CVCB3	155.853,66	32.240,59	22.173,15	0,08%	81.536,08	255,89	(67.873,43)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	677.537.999,87	VAR / PL:	3,980%
VAR:	26.967.724,81	ETL / PL:	4,9914%
ETL:	33.818.626,48	VAR / CDI:	13604,78%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.251,76)	BAIXA 1:	1.426,59	Cenário 1:	92.281.257,86
				Cenário 2:	281.395,39
				Cenário 3:	(86.076.353,55)

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
CYRE3	1.387.444,80	186.185,05	138.089,38	0,51%	452.461,42	1.527,58	(441.987,50)
DXCO3	253.087,11	35.361,74	15.509,72	0,06%	23.698,73	-	(28.985,80)
ECOR3	143.946,90	14.225,54	9.527,19	0,04%	20.512,39	74,78	(23.836,19)
EGIE3	5.264.585,08	247.686,74	(31.671,72)	-0,12%	(312.276,98)	(1.254,91)	456.148,70
ELET3	3.538.168,79	401.305,73	274.894,53	1,02%	947.391,61	3.274,22	(975.100,95)
ELET6	6.615.536,65	834.938,47	582.935,44	2,16%	2.050.509,39	6.967,21	(2.031.731,50)
ENAT3	1.971.360,00	321.883,35	135.653,77	0,50%	405.291,22	1.437,50	(442.301,81)
ENBR3	256.564,60	19.022,12	(798,82)	0,00%	(40.026,79)	(169,60)	66.505,89
ENEV3	3.196.935,45	328.748,21	59.992,32	0,22%	94.614,80	363,54	(124.228,03)
ENGI11	577.632,02	69.311,91	46.346,35	0,17%	50.719,44	189,56	(62.425,15)
EQTL3	13.067.601,17	945.824,86	420.402,97	1,56%	1.372.153,50	5.087,91	(1.658.047,50)
ESPA3	1.857.653,95	439.324,09	164.723,38	0,61%	1.062.529,17	-	(853.002,19)
EUCATEX PN	111.188,00	11.268,72	8.610,14	0,03%	17.886,25	64,68	(20.400,48)
EZTC3	94.981,04	12.341,21	9.132,62	0,03%	34.227,03	114,03	(32.461,41)
FLRY3	269.911,50	24.179,48	8.907,83	0,03%	39.676,68	144,36	(45.894,33)
GETT11	16.511,00	9.421,38	5.111,17	0,02%	33.451,63	-	(12.843,95)
GGBR4	8.348.828,41	779.220,22	202.627,64	0,75%	553.031,64	2.087,94	(696.861,25)
GGPS3	3.534.258,74	356.786,74	89.602,34	0,33%	639.034,51	-	(714.498,04)
GMAT3	5.522.153,42	1.341.072,57	302.944,42	1,12%	1.676.148,99	5.709,79	(1.670.299,36)
GNDI3	13.079.855,75	1.882.902,88	60.334,08	0,22%	105.606,20	410,08	(142.153,80)
GOAU4	1.204.546,95	104.479,00	17.601,11	0,07%	94.553,08	354,93	(117.555,27)
GOLL4	136.928,00	23.887,20	16.144,77	0,06%	45.659,75	153,71	(44.317,99)
HAPV3	14.891.528,14	2.467.622,92	(24,93)	0,00%	15.572,95	60,68	(21.136,00)
HBSA3	338.373,31	51.020,79	38.068,44	0,14%	192.841,44	595,50	(155.047,72)
HYPE3	3.492.052,56	302.332,54	29.915,68	0,11%	236.807,84	893,39	(297.879,32)
IFCM3	3.190.140,00	4.089,55	425,45	0,00%	-	-	-
IGTI11	423.320,00	76.321,97	11.181,58	0,04%	-	-	-
INTB3	5.385.815,28	568.166,35	229.649,45	0,85%	428.555,31	-	(532.188,70)
IRBR3	276.473,57	42.092,14	10.000,26	0,04%	63.602,95	223,27	(67.804,87)
ITSA4	16.862.333,27	1.457.551,87	885.265,67	3,28%	3.265.842,30	11.642,59	(3.605.604,94)
ITUB4	31.955.036,85	3.027.053,07	1.297.376,12	4,81%	5.977.834,01	21.371,43	(6.642.630,28)
JBSS3	16.727.764,31	2.277.210,60	447.688,96	1,66%	298.708,50	1.154,33	(397.533,15)
JHSF3	73.108,50	5.893,97	3.483,22	0,01%	15.560,88	55,02	(16.863,46)
KLBN11	993.636,49	80.453,10	(17.991,69)	-0,07%	(8.982,37)	(35,18)	12.337,61
LAME4	2.089.337,61	668.681,95	(30.682,88)	-0,11%	(314.870,21)	(1.330,13)	519.275,80
LCAM3	1.362.813,06	268.286,23	112.239,35	0,42%	119.594,47	447,00	(147.204,05)
LTRE3	12.350.827,81	1.376.484,92	183.725,79	0,68%	83.719,02	325,29	(112.863,00)
LWSA3	3.278.453,64	1.084.231,07	235.545,90	0,87%	1.935.809,03	5.936,34	(1.533.360,97)
MATD3	2.932.065,06	1.031,13	(99,41)	0,00%	-	-	-
MDNE3	65.191,00	9.302,33	7.411,82	0,03%	34.182,10	107,23	(28.429,03)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	677.537.999,87	VAR / PL:	3,980%
VAR:	26.967.724,81	ETL / PL:	4,9914%
ETL:	33.818.626,48	VAR / CDI:	13604,78%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.251,76)	BAIXA 1:	1.426,59	Cenário 1:	92.281.257,86
				Cenário 2:	281.395,39
				Cenário 3:	(86.076.353,55)

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
MGLU3	6.962.038,21	1.518.290,39	601.011,72	2,23%	5.349.974,17	15.491,28	(3.753.678,66)
MOVI3	7.668.460,00	1.422.514,26	533.640,52	1,98%	585.625,13	2.200,49	(729.782,89)
MRFG3	421.078,05	78.640,77	25.126,59	0,09%	10.506,45	40,46	(13.868,47)
MRVE3	444.176,68	79.117,52	26.147,01	0,10%	32.797,39	123,38	(40.983,89)
MULT3	7.216.112,40	1.278.319,18	121.983,92	0,45%	(562.514,66)	(2.282,89)	841.382,83
NTCO3	16.205.554,13	4.112.554,35	692.829,58	2,57%	9.879.134,37	30.101,19	(7.718.638,23)
OMGE3	3.131.901,72	390.124,59	112.396,15	0,42%	664.864,96	2.351,46	(720.906,69)
PACUCAR_CBD ON ED	179.625,60	26.816,55	12.116,90	0,04%	52.546,45	179,79	(52.880,78)
PARD3	676.260,05	128.403,55	30.806,92	0,11%	89.918,67	329,22	(105.518,90)
PETR3	30.815.618,26	3.664.371,68	2.122.197,46	7,87%	3.429.849,53	12.681,24	(4.116.953,95)
PETR4	41.492.915,58	5.361.624,58	2.976.387,30	11,04%	5.345.093,20	19.606,26	(6.299.402,94)
PETZ3	261.568,44	43.659,16	24.986,79	0,09%	69.458,36	240,27	(71.635,57)
POWE3	63.441,00	7.727,80	565,64	0,00%	2.620,58	-	(3.395,28)
PRIO3	11.776.031,94	4.371.817,29	1.107.641,08	4,11%	3.163.180,19	10.928,28	(3.253.165,34)
QUAL3	474.416,80	55.429,58	3.180,00	0,01%	70.593,41	256,64	(81.506,18)
RADL3	7.117.824,73	954.470,32	(111.992,73)	-0,42%	(440.804,10)	(1.773,84)	646.014,54
RAIL3	14.249.533,55	1.858.208,11	719.907,12	2,67%	926.641,82	3.500,48	(1.169.198,17)
RAPT4	4.044.978,00	430.734,03	216.925,32	0,80%	512.365,71	1.881,22	(605.194,16)
RDOR3	825.998,88	122.920,55	35.800,86	0,13%	276.428,57	-	(268.025,42)
RECV3	1.153.926,00	264.827,41	155.534,81	0,58%	514.334,95	-	(454.668,34)
RENT3	5.817.749,08	1.072.147,41	438.537,35	1,63%	593.572,07	2.203,96	(719.517,23)
SANB11	579.766,40	36.319,46	8.527,89	0,03%	31.090,81	118,09	(39.728,60)
SBSP3	585.055,28	63.958,70	39.611,47	0,15%	83.680,26	305,00	(97.186,95)
SEER3	617.308,34	86.223,60	44.473,32	0,16%	197.867,57	669,50	(194.234,48)
SOMA3	3.573.755,64	438.268,94	276.348,65	1,02%	929.733,99	3.223,22	(963.648,33)
STBP3	6.527.902,00	1.568.347,59	951.151,80	3,53%	3.162.078,06	10.060,68	(2.711.487,60)
SULA11	2.911.933,44	455.539,73	(130.716,71)	-0,48%	(379.604,89)	(1.585,28)	608.645,96
SUZB3	20.088.263,53	3.226.192,37	(70.003,17)	-0,26%	(784.090,58)	(3.117,92)	1.116.790,64
SYNE3	377.235,00	74.869,83	(32.359,89)	-0,12%	(108.847,88)	-	221.901,27
TAAE11	404.076,45	22.469,54	5.293,36	0,02%	14.500,86	55,55	(18.903,40)
TEND3	1.884.528,00	359.615,03	(42.882,29)	-0,16%	(180.549,59)	(739,80)	276.392,57
TIMS3	2.989.770,00	448.535,67	142.322,85	0,53%	(376.787,61)	(1.569,71)	600.566,28
TOTS3	8.873.643,67	840.275,58	116.283,40	0,43%	268.696,50	1.032,07	(352.519,02)
UGPA3	4.855.391,97	687.376,19	388.500,92	1,44%	987.250,19	3.504,99	(1.079.763,81)
USIM5	7.872.985,98	1.384.461,16	945.197,33	3,50%	3.814.816,30	12.136,82	(3.270.829,06)
VALE3	52.527.273,75	5.613.817,57	2.853.379,02	10,58%	17.201.311,47	58.043,30	(16.783.123,83)
VBBR3	6.186.302,72	575.905,07	319.474,62	1,18%	826.191,26	-	(968.941,58)
VIIA3	462.893,13	76.627,20	53.616,40	0,20%	251.945,60	-	(206.433,30)
VITT3	372.775,60	3.658.813,97	801.924,29	2,97%	-	-	-
VIVT3	1.141.532,71	113.396,24	4.106,95	0,02%	(211.413,01)	(911,15)	366.329,86



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	677.537.999,87	VAR / PL:	3,980%
VAR:	26.967.724,81	ETL / PL:	4,9914%
ETL:	33.818.626,48	VAR / CDI:	13604,78%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.251,76)	BAIXA 1:	1.426,59	Cenário 1:	92.281.257,86
				Cenário 2:	281.395,39
				Cenário 3:	(86.076.353,55)

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
WEGE3	11.779.033,65	2.268.609,40	399.903,64	1,48%	2.370.963,70	8.424,87	(2.598.290,15)
WEST3	52.470,00	46.971,75	4.993,30	0,02%	80.372,77	-	(37.621,08)
YDUQ3	1.368.151,59	164.059,43	117.346,27	0,44%	319.266,73	1.119,20	(339.296,76)
INDZ21	920.412,00	39.052,19	36.502,26	0,14%	132.840,90	-	(154.077,80)
COMPROMISSADA	24.939.567,20	640,57	321,46	0,00%	1.159,58	(603,03)	(1.789,84)
EMP AÇÃO PROVISÃO	7.689,75	2,13	1,23	0,00%	4,40	(2,28)	(6,77)
LFT	300.910,96	59,03	4,10	0,00%	0,01	0,00	(0,01)
Total	682.124.283,09	92.023.741,06	26.967.724,81	100,00%	92.281.257,86	281.395,39	(86.076.353,55)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIR F EMB II CNPJ - 11005764000196

Dados Gerais

PL:	1.837.074.680,90	VAR / PL:	5,096%
VAR:	93.625.467,79	ETL / PL:	6,3911%
ETL:	117.410.154,06	VAR / CDI:	17420,00%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(168.866.543,40)	BAIXA 1:	221.855.050,20	Cenário 1:	132.789.771,73
				Cenário 2:	(62.735.970,36)
				Cenário 3:	(239.849.698,41)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	5.000,00	13,88	0,08	0,00%	(158,26)	(0,63)	223,38
RECEBER	(57.236,30)	158,88	(0,97)	0,00%	1.811,61	7,18	(2.557,06)
COMPROMISSADA	122.541.470,21	341.378,61	3.493,13	0,00%	(3.872.903,78)	(18.327,85)	5.465.813,01
GASP17	30.448.271,69	1.033.196,48	1.003.474,61	1,07%	155.485,69	(30.223,73)	(839.639,16)
CSMGC3	13.112.809,90	297.570,41	225.494,91	0,24%	(205.722,22)	(76.719,43)	151.534,31
DE252 PETR IPCA - PETR45	14.022.755,45	330.409,56	237.126,35	0,25%	(221.077,78)	(81.561,96)	155.890,67
SBESC7	10.054.385,04	124.364,48	85.647,76	0,09%	(277.747,68)	(15.918,71)	361.352,30
SBSPC2	8.021.832,16	189.433,66	147.807,20	0,16%	(113.845,71)	(51.110,94)	66.718,59
ELET42	11.121.213,10	375.503,45	353.031,61	0,38%	86.348,34	(151.628,65)	(356.680,04)
ENTV12	11.660.396,19	369.311,62	348.407,08	0,37%	83.844,91	(163.903,94)	(325.087,38)
IGSN15	2.286.223,27	79.468,01	75.959,82	0,08%	27.667,28	(34.673,06)	(82.148,11)
NEOE16	5.958.455,25	194.419,82	183.408,45	0,20%	36.260,49	(76.030,37)	(179.704,71)
LFS0120016V	5.149.459,62	72.751,77	42.911,97	0,05%	(137.952,20)	(9.756,85)	175.070,95
LFS012001GU	807.125,53	13.869,48	9.197,18	0,01%	(19.494,96)	(2.298,49)	22.840,11
LFS012001GZ	4.035.627,64	69.347,40	45.985,92	0,05%	(97.474,78)	(11.492,47)	114.200,54
LFS012001H2	9.685.506,33	166.433,75	110.366,20	0,12%	(233.939,47)	(27.581,94)	274.081,31
LFS012001H4	7.264.129,75	124.825,31	82.774,65	0,09%	(175.454,60)	(20.686,45)	205.560,98
LFS012001H6	5.649.878,69	97.086,36	64.380,28	0,07%	(136.464,69)	(16.089,46)	159.880,76
NTNB	1.692.540.136,01	90.622.956,92	90.606.001,57	96,77%	137.890.589,55	(61.947.972,59)	(245.217.048,85)
Total	1.954.307.439,54	94.502.499,85	93.625.467,79	100,00%	132.789.771,73	(62.735.970,36)	(239.849.698,41)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FI RF EMB V CREDITO PRIVADO CNPJ - 20726178000121

Dados Gerais

PL:	181.382.352,00	VAR / PL:	1,682%
VAR:	3.050.351,17	ETL / PL:	2,1090%
ETL:	3.825.264,74	VAR / CDI:	5748,25%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(4.379.160,96)	BAIXA 1:	2.874.116,78	Cenário 1:	2.646.964,30
				Cenário 2:	(875.570,54)
				Cenário 3:	(5.370.818,87)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(25.097,46)	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	1.594.471,41	40,95	31,41	0,00%	74,14	(38,55)	(114,43)
CMTR33	5.413.512,70	30.003,49	17.263,83	0,57%	(2.767,25)	1.018,19	6.236,71
17H0164854	7.878.811,06	180.942,56	180.817,14	5,93%	164.166,42	(58.365,05)	(329.162,98)
AEGP23	11.993.799,70	303.829,78	302.961,78	9,93%	254.034,82	(91.439,43)	(522.416,95)
CCRDD1	4.660.848,03	109.167,12	107.861,55	3,54%	82.392,16	(29.453,47)	(171.907,76)
CMDT33	2.576.104,68	45.509,66	45.262,90	1,48%	31.511,31	(11.344,91)	(67.479,14)
100 - GASP17	6.299.642,42	213.426,24	188.439,23	6,18%	231.561,56	(5.463,31)	(455.158,43)
GEPA24	14.125.262,06	214.199,68	202.473,91	6,64%	114.574,20	(41.516,17)	(249.077,72)
ERDV17	10.474.146,46	258.266,52	257.269,05	8,43%	213.840,65	(77.167,32)	(439.383,16)
ERDV36	3.107.232,02	72.778,08	71.907,70	2,36%	54.928,11	(19.635,65)	(114.605,17)
ECPT11	3.061.918,34	27.856,61	25.442,62	0,83%	7.528,36	(2.720,70)	(16.261,92)
ECPT21	462.981,10	3.322,92	2.245,03	0,07%	293,45	(107,48)	(654,26)
ECPT31	610.631,91	6.465,55	5.653,13	0,19%	2.162,50	(788,17)	(4.765,83)
ECPT41	1.005.523,74	14.757,48	13.845,86	0,45%	6.827,36	(2.480,40)	(14.933,56)
SULM23	1.035.634,22	8.210,01	5.991,73	0,20%	1.480,22	(541,43)	(3.289,74)
RDCO34	8.387.096,85	81.817,58	74.829,62	2,45%	51.103,13	(21.038,81)	(99.259,36)
SBESC7	233.822,91	2.527,97	2.397,32	0,08%	941,56	(340,88)	(2.042,62)
SBSPC2	6.147.616,02	138.042,06	137.409,46	4,50%	107.333,40	(38.398,59)	(223.517,62)
TAE33	11.262.421,24	236.964,99	234.055,48	7,67%	163.641,92	(59.019,17)	(351.875,78)
ENMI21	1.023.691,35	25.240,53	25.188,23	0,83%	23.599,20	(8.418,05)	(47.444,73)
ENTV12	15.328.562,49	477.869,98	460.854,15	15,11%	595.390,62	(213.543,42)	(1.112.166,40)
ENJG21	1.695.444,87	40.388,68	40.332,88	1,32%	37.134,88	(13.251,37)	(74.817,83)
ECCR32	3.290.977,00	48.299,72	45.316,10	1,49%	22.345,26	(8.118,10)	(48.876,04)
LFS012001IP	8.087.502,17	128.510,96	121.354,57	3,98%	62.626,37	(22.734,37)	(136.729,79)
LFSN16000GM	12.034.816,93	358.828,85	357.469,92	11,72%	305.523,17	(109.616,64)	(648.973,10)
D - LFSN1800DC5	3.893.147,76	124.834,11	123.676,58	4,05%	114.716,78	(41.047,31)	(242.141,25)
Total	145.661.521,98	3.152.102,08	3.050.351,17	100,00%	2.646.964,30	(875.570,54)	(5.370.818,87)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIM EMB I A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	221.777.366,37	VAR / PL:	0,291%
VAR:	645.057,62	ETL / PL:	0,3647%
ETL:	808.928,55	VAR / CDI:	994,17%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	64.102,70	BAIXA 1:	129.207,94	Cenário 1:	(905.240,09)
				Cenário 2:	52.536,25
				Cenário 3:	2.253.176,45

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	14,01	5,62	0,00%	(93,95)	(0,37)	129,25
RECEBER	85.629,25	133,28	53,47	0,01%	(893,83)	(3,50)	1.229,75
AMER3	134.044,72	28.129,30	(3.040,65)	-0,47%	8.378,89	(5,48)	(10.305,66)
BBDC4	517.660,00	43.038,40	(16.636,04)	-2,58%	25.480,71	95,79	(31.766,24)
BKBR3	191.552,00	37.464,58	11.561,74	1,79%	(3.341,06)	(13,08)	4.589,19
BRIT3	102.030,00	21.183,01	8.383,01	1,30%	88.438,50	(4,17)	(57.209,03)
CASH3	201.526,00	63.944,14	8.634,36	1,34%	158.256,67	(8,24)	(107.673,32)
CBAV3	134.064,00	34.125,10	11.773,13	1,83%	41.538,80	(5,48)	(40.233,78)
CRFB3	329.595,00	18.830,54	8.184,49	1,27%	42.112,69	152,91	(48.434,62)
CSAN3	671.457,50	77.897,39	(891,19)	-0,14%	112.814,19	402,51	(124.643,23)
CURY3	76.049,00	7.165,79	2.093,69	0,32%	8.678,57	31,70	(10.120,99)
ENEV3	566.370,00	57.852,85	27.856,59	4,32%	10.850,02	41,24	(13.874,43)
EQTL3	674.843,00	49.452,98	34.142,84	5,29%	63.817,13	235,15	(75.933,98)
HAPV3	820.432,00	135.447,93	68.879,33	10,68%	(7.705,98)	(30,22)	10.618,06
LAME4	204.446,72	65.206,90	(9.084,46)	-1,41%	(32.944,90)	(138,52)	53.748,52
LJQQ3	147.340,85	19.970,08	9.728,95	1,51%	99.348,85	293,90	(72.698,49)
LREN3	1.166.450,00	128.586,35	26.157,85	4,06%	(4.269,13)	(17,00)	6.092,68
MGLU3	216.270,60	47.419,00	30.430,25	4,72%	163.935,51	472,38	(113.499,33)
MULT3	356.720,00	62.686,57	(4.957,18)	-0,77%	(31.530,82)	(127,44)	46.715,75
NTCO3	864.649,24	220.613,65	116.012,59	17,98%	518.076,86	1.570,68	(399.411,31)
ONCO3	152.096,00	26.760,28	19.095,82	2,96%	94.675,77	(6,22)	(71.798,78)
PETZ3	451.608,00	75.574,98	49.254,02	7,64%	115.208,49	396,36	(117.195,86)
RADL3	592.443,36	78.870,89	20.278,70	3,14%	(42.873,92)	(171,88)	62.278,52
RAIZ4	440.070,54	88.885,58	30.423,77	4,72%	151.361,64	(18,00)	(142.345,39)
RDOR3	321.088,00	48.255,58	22.410,15	3,47%	104.103,60	(13,14)	(99.577,43)
RENT3	153.330,00	28.100,22	(475,22)	-0,07%	14.043,41	51,81	(16.761,25)
SMFT3	220.698,00	21.539,76	11.524,62	1,79%	54.870,57	(9,03)	(56.150,28)
SQIA3	133.042,00	18.581,32	4.602,91	0,71%	27.677,77	97,09	(29.419,36)
SUZB3	224.640,00	35.835,23	(4.711,31)	-0,73%	(11.113,08)	(44,06)	15.714,81
UGPA3	242.424,00	34.157,50	(7.641,49)	-1,18%	46.761,73	165,08	(50.429,80)
VALE3	237.830,00	25.415,16	(9.094,16)	-1,41%	75.400,57	253,08	(72.574,11)
DI1F22	45.137.883,70	88.638,99	33.599,49	5,21%	(413.764,50)	(31.632,75)	559.961,08
DI1J22	16.066.006,22	68.877,27	12.916,38	2,00%	(84.688,53)	(43.550,88)	103.963,91
DI1F23	(16.811.012,72)	343.466,28	319,86	0,05%	(147.906,81)	165.736,98	242.377,89
DOLF22	(283.061,74)	11.962,66	3.903,41	0,61%	7.799,98	2.373,99	(10.851,80)
WDOF22	(1.019.022,27)	43.065,56	14.052,29	2,18%	28.079,94	8.546,38	(39.066,49)
COMPROMISSADA	179.744.023,90	280.245,78	111.116,57	17,23%	(1.867.873,98)	(11.699,21)	2.568.469,49
DE252 AERIS CDI - AERI11	1.276.120,37	2.594,33	622,12	0,10%	(11.286,93)	(1.076,99)	15.347,71
ANHB10	921.710,64	1.441,93	510,54	0,08%	(9.063,66)	(317,86)	12.424,01
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.721.553,91	2.706,08	1.005,83	0,16%	(17.384,37)	(368,35)	23.852,47



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIM EMB I A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	221.777.366,37	VAR / PL:	0,291%
VAR:	645.057,62	ETL / PL:	0,3647%
ETL:	808.928,55	VAR / CDI:	994,17%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	64.102,70	BAIXA 1:	129.207,94	Cenário 1:	(905.240,09)
				Cenário 2:	52.536,25
				Cenário 3:	2.253.176,45

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 BCBF CDI - BCBF14	270.420,54	505,17	140,57	0,02%	(2.489,96)	(179,12)	3.394,36
CGBP13	2.398.275,50	5.606,78	747,29	0,12%	(17.938,53)	(3.595,34)	24.419,79
DE252 ELETROB CDI -	2.080.167,88	4.173,90	916,53	0,14%	(17.882,75)	(2.002,67)	24.323,89
ETEN13	2.914.342,72	73.310,85	(8.862,26)	-1,37%	76.549,18	(51.740,64)	(104.151,93)
EQTL13	1.458.694,63	2.378,72	823,56	0,13%	(14.353,44)	(501,89)	19.658,80
GRRB14	1.082.942,22	1.701,68	580,55	0,09%	(10.483,92)	(455,32)	14.361,98
IVIA35	1.306.981,07	2.152,12	727,32	0,11%	(12.743,49)	(507,96)	17.446,17
LORTA1	617.443,07	907,65	360,83	0,06%	(6.559,86)	34,33	9.043,96
MOVI33	1.442.937,67	2.170,09	864,18	0,13%	(15.061,85)	(59,03)	20.722,50
OMGE13	1.108.525,11	2.662,76	326,39	0,05%	(8.135,77)	(1.738,08)	11.069,80
PRLG14	3.237.543,26	56.670,95	6.844,63	1,06%	(95.686,37)	31.112,81	137.426,88
CBAN22	1.115.472,72	2.220,94	487,57	0,08%	(9.550,83)	(1.090,90)	12.998,60
SULM15	658.108,33	1.123,20	413,23	0,06%	(7.657,59)	379,06	10.648,79
VIVT15	2.141.420,46	28.257,80	663,12	0,10%	(854,65)	(11.336,86)	(2.718,67)
VAMO22	1.105.643,77	2.111,80	526,26	0,08%	(9.828,53)	(904,71)	13.386,60
LF selic	3.020.024,37	4.541,93	1.808,69	0,28%	(31.523,99)	(123,54)	43.371,55
LF0021006S0	1.014.340,68	1.525,51	607,49	0,09%	(10.588,02)	(41,50)	14.567,28
LF002100HDP	1.208.016,10	1.816,78	723,48	0,11%	(12.609,66)	(49,42)	17.348,71
LF002100HDQ	2.200.690,46	3.309,70	1.318,00	0,20%	(22.971,52)	(90,03)	31.604,83
LF002100ISJ	2.256.151,94	3.393,11	1.351,21	0,21%	(23.550,44)	(92,30)	32.401,33
NTNB	100.685,09	6.382,15	(784,50)	-0,12%	13.356,77	(4.596,83)	(22.067,95)
IDIJQFM	8.784,16	66.418,86	12.455,36	1,93%	2.069.634,27	(8.275,75)	(8.159,42)
IDIJQFN	(17.637,76)	111.901,35	(20.984,58)	-3,25%	(2.109.284,57)	16.736,81	16.540,45
Total	270.123.575,76	2.829.381,05	645.057,62	100,00%	(905.240,09)	52.536,25	2.253.176,45



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIM EMB II A CNPJ - 20725957000102

Dados Gerais

PL:	217.127.143,92	VAR / PL:	0,907%
VAR:	1.968.647,14	ETL / PL:	1,1370%
ETL:	2.468.763,78	VAR / CDI:	3099,09%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(3.259.308,76)	BAIXA 1:	4.569.325,81	Cenário 1:	235.305,17
				Cenário 2:	(1.287.641,56)
				Cenário 3:	(1.410.936,69)

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	14,01	(7,15)	0,00%	(93,95)	(0,37)	129,25
RECEBER	(27.261,16)	42,43	21,67	0,00%	284,56	1,12	(391,51)
WSPZ21	3.207.031,06	174.478,96	(112.451,82)	-5,71%	(377.575,94)	(28.994,47)	580.876,06
INDZ21	7.976.904,00	339.246,45	49.357,09	2,51%	1.068.022,07	(326,32)	(1.220.781,69)
WINZ21	(18.817.312,00)	800.273,68	(116.432,10)	-5,91%	(2.519.436,67)	769,79	2.879.792,71
DI1F22	2.480.103,50	4.870,27	(1.474,40)	-0,07%	(22.734,31)	(1.738,06)	30.767,09
DI1J22	1.354.964,38	5.808,93	1.288,32	0,07%	(7.142,41)	(3.672,97)	8.768,04
DI1N22	751.843,21	7.243,75	2.996,34	0,15%	(518,00)	(3.801,07)	(311,59)
DI1V22	911.096,59	14.033,60	7.334,59	0,37%	3.817,76	(6.864,40)	(6.975,95)
DI1F23	(25.039.561,06)	511.583,98	(295.922,03)	-15,03%	(220.303,30)	246.860,87	361.015,49
DI1N23	1.590.604,51	44.742,57	30.157,10	1,53%	28.146,07	(22.752,58)	(43.367,92)
DI1F24	2.703.225,47	89.140,85	68.403,39	3,47%	70.666,69	(49.940,59)	(106.020,30)
DI1N24	830.286,46	30.997,63	25.102,18	1,28%	28.726,85	(18.763,53)	(42.300,70)
DI1F25	1.429.547,13	59.550,80	50.283,82	2,55%	62.208,10	(38.445,94)	(90.143,90)
DI1F27	982.906,60	61.358,79	55.423,18	2,82%	77.850,37	(42.794,99)	(107.136,55)
DI1F29	1.118.346,81	91.901,49	83.024,82	4,22%	130.464,11	(67.253,31)	(171.405,04)
DI1F31	263.548,91	26.578,95	23.607,42	1,20%	40.841,95	(20.099,57)	(51.347,82)
WDOF22	1.358.696,35	57.420,75	(24.472,33)	-1,24%	(37.439,93)	(11.395,17)	52.088,66
COMPROMISSADA	68.722.719,04	107.148,22	(53.556,10)	-2,72%	(714.156,59)	(4.473,04)	982.019,89
AEGP13	1.068.193,67	1.642,01	(745,24)	-0,04%	(11.016,05)	(112,38)	15.138,86
CPGT14	297.726,65	1.325,69	(1.113,55)	-0,06%	(4.452,36)	677,39	6.303,67
CPGT16	296.044,15	851,18	(779,31)	-0,04%	(3.880,01)	388,28	5.420,11
ERDV18	1.807.798,70	33.483,44	30.402,12	1,54%	31.660,85	(24.204,52)	(41.774,61)
ESUL18	1.000.510,97	1.589,47	(1.375,90)	-0,07%	(11.465,28)	488,60	15.936,90
LORTA1	545.408,04	801,75	(443,72)	-0,02%	(5.794,54)	30,33	7.988,83
VIVT15	2.893.811,43	38.186,22	20.472,24	1,04%	(1.154,93)	(15.320,09)	(3.673,88)
LF selic	3.745.990,79	7.698,27	(6.608,84)	-0,34%	(44.359,39)	2.584,77	61.931,99
LFT	37.925.872,23	70.502,22	(43.021,66)	-2,19%	(395.882,48)	(1.551,49)	544.665,74
NTNB	102.101.992,71	2.243.130,62	2.179.181,71	110,69%	2.373.557,22	(1.176.936,92)	(5.078.148,84)
IDIFQG0	(43,50)	63,43	19,20	0,00%	(48.008,51)	15,69	41,55
IDIFQG1	43,50	64,24	(19,45)	0,00%	51.329,35	(15,85)	(41,53)
IDIFQG7	60,00	96,01	(29,06)	0,00%	108.528,42	(23,22)	(57,13)
IDIFQG8	(120,00)	194,73	58,95	0,00%	(234.137,59)	46,92	114,21
IDIFQG9	60,00	98,76	(29,90)	0,00%	126.454,58	(23,71)	(57,08)
IDIFQHM	(70,00)	320,08	96,90	0,00%	(10.030.941,87)	49,37	62,50
IDIFQHN	70,00	334,72	(101,33)	-0,01%	10.723.240,34	(50,13)	(62,22)
Total	203.490.039,16	4.826.818,94	1.968.647,14	100,00%	235.305,17	(1.287.641,56)	(1.410.936,69)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIM EMB III A IMOBILIÁRIO CNPJ - 32711990000162

Dados Gerais

PL:	81.579.932,70	VAR / PL:	1,476%
VAR:	1.203.895,06	ETL / PL:	1,8506%
ETL:	1.509.733,49	VAR / CDI:	5044,13%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(2,33)	BAIXA 1:	2,39	Cenário 1:	14.646.146,75
				Cenário 2:	45.443,39
				Cenário 3:	(17.626.679,40)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	44,04	(34,04)	0,00%	78,99	0,30	(98,16)
RECEBER	(37.740,85)	1.661,97	1.284,85	0,11%	(2.981,26)	(11,19)	3.704,52
AIEC11	879.047,75	65.058,29	(40.351,14)	-3,35%	122.417,23	260,59	(153.483,66)
BLCP11	1.526.877,30	67.238,14	(51.980,92)	-4,32%	120.612,52	452,64	(149.873,31)
BMLC11	2.027.821,20	89.297,89	(69.035,03)	-5,73%	160.183,55	601,15	(199.044,34)
BPML11	1.242.435,01	51.622,56	(16.055,83)	-1,33%	180.006,19	677,44	(225.146,39)
CBOP11	41.703,98	1.965,01	(533,26)	-0,04%	6.927,32	25,95	(8.568,34)
CEOC11	770.580,00	55.135,90	39.427,66	3,28%	241.049,78	859,94	(267.036,68)
CNES11	550.224,84	28.188,53	2.701,39	0,22%	115.681,73	427,73	(138.905,67)
GALG11	1.263.694,32	50.615,86	(28.598,25)	-2,38%	183.416,71	374,62	(229.385,03)
GALG13	492,10	15,75	(11,28)	0,00%	38,87	0,15	(48,30)
HBRH11	2.385.752,80	105.059,90	(81.220,43)	-6,75%	188.457,61	707,26	(234.177,74)
HSML11	7.766.449,10	308.824,06	259.327,28	21,54%	1.717.511,20	6.327,89	(2.045.696,31)
JRDM11	1.019.400,00	36.958,39	13.980,69	1,16%	163.057,05	611,65	(202.395,79)
LVBH11	3.405.308,89	244.131,43	218.744,53	18,17%	825.048,91	3.018,15	(966.925,61)
MALL11	6.674.986,61	460.050,11	392.016,06	32,56%	1.710.827,82	6.228,06	(1.983.107,10)
MAXR11	1.392.674,65	83.093,36	58.862,51	4,89%	277.640,31	1.030,09	(336.004,79)
NEWU11	600.237,00	26.432,26	(20.434,43)	-1,70%	47.414,48	177,94	(58.917,31)
PATC11	7.946.964,55	348.698,04	(152.509,65)	-12,67%	739.112,63	2.787,04	(928.910,92)
PVBH11	457.787,73	27.264,28	(14.059,34)	-1,17%	45.884,19	135,71	(57.823,20)
QAGR11	8.108.776,22	250.230,46	165.468,09	13,74%	1.311.811,83	2.403,86	(1.626.632,18)
RBGS11	504.426,00	35.247,31	13.627,02	1,13%	158.957,55	566,60	(175.765,99)
RBRL11	1.702.957,16	64.670,94	18.638,37	1,55%	418.454,60	504,84	(489.099,93)
RCRB11	1.625.349,06	69.936,08	46.516,03	3,86%	247.666,23	930,64	(308.660,27)
RNGO11	135.354,00	7.502,16	5.547,93	0,46%	29.044,37	107,24	(34.764,04)
SDIL11	358.594,60	18.501,06	(9.026,81)	-0,75%	51.994,40	195,67	(65.029,73)
TEPP11	7.307.826,75	361.617,39	273.730,19	22,74%	1.559.279,72	5.759,54	(1.868.016,70)
TRXF11	12.935.746,25	223.046,87	21.267,40	1,77%	1.858.500,16	6.995,94	(2.325.812,07)
VISC11	6.303,00	209,97	42,20	0,00%	1.137,72	4,24	(1.394,70)
VVPR11	1.339.880,00	59.003,45	(45.614,80)	-3,79%	105.841,05	397,21	(131.518,27)
XPIN11	3.513.216,90	132.609,45	96.088,06	7,98%	848.910,37	1.041,50	(995.393,04)
XPPR11	3.138.089,60	210.979,35	161.751,84	13,44%	801.339,68	930,29	(929.566,45)
COMPROMISSADA	92.132,85	4.056,68	(3.136,51)	-0,26%	7.282,13	25,09	(9.050,07)
FII HSI LOGISTICA	1.029.373,95	42.986,15	14.363,54	1,19%	248.337,36	305,16	(291.275,45)
FII VIA PQ SHOPPING	1.964.779,90	86.521,78	(66.888,85)	-5,56%	155.203,73	582,46	(192.856,41)
Total	83.678.503,22	3.618.474,88	1.203.895,06	100,00%	14.646.146,75	45.443,39	(17.626.679,40)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	393.251.415,85	VAR / PL:	3,858%
VAR:	15.171.454,62	ETL / PL:	4,8380%
ETL:	19.025.622,69	VAR / CDI:	13186,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(294,15)	BAIXA 1:	300,89	Cenário 1:	52.489.140,70
				Cenário 2:	163.757,29
				Cenário 3:	(47.762.414,13)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	10.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	813.507,70	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	18.033.854,30	3.169.337,11	(490.974,92)	-3,24%	(3.830.346,20)	(16.779,00)	6.911.907,50
ASAI3	3.325.200,00	697.119,27	125.265,57	0,83%	1.447.169,98	-	(1.290.106,64)
B3SA3	15.769.856,19	1.391.564,67	46.942,37	0,31%	872.231,75	3.310,17	(1.112.468,75)
UNT	9.343.428,00	877.564,27	548.550,69	3,62%	2.222.926,41	7.777,71	(2.352.262,87)
BBAS3	13.254.992,00	1.351.856,44	975.995,40	6,43%	640.542,14	2.439,01	(823.370,39)
BBDC4	23.760.414,81	1.996.473,14	740.129,91	4,88%	1.417.575,40	5.368,66	(1.799.291,42)
BIDI11	1.760.778,00	353.684,24	110.817,55	0,73%	523.508,34	1.787,77	(524.584,09)
BPAN4	2.272.268,00	418.085,89	239.818,47	1,58%	1.426.826,17	4.321,08	(1.100.429,28)
CESP6	3.151.902,00	291.945,19	(91.949,55)	-0,61%	(280.749,90)	(1.146,19)	426.017,31
CIEL3	2.475.306,00	335.844,19	74.694,51	0,49%	341.214,27	1.246,54	(398.401,98)
CPFE3	5.293.200,00	451.475,46	118.699,51	0,78%	4.626,08	18,03	(6.279,91)
CSED3	2.364.700,00	546.969,43	273.219,98	1,80%	697.542,94	-	(700.439,98)
EGIE3	4.758.455,00	223.874,48	(30.188,25)	-0,20%	(282.255,09)	(1.134,27)	412.295,18
ELET6	3.118.465,00	393.577,50	231.693,68	1,53%	966.579,45	3.284,24	(957.727,83)
ENAT3	1.971.360,00	321.883,35	135.211,31	0,89%	405.291,22	1.437,50	(442.301,81)
ENEV3	2.296.170,00	236.120,43	37.215,30	0,25%	67.956,22	261,11	(89.225,66)
GGBR4	6.682.200,00	623.668,99	269.321,17	1,78%	442.633,13	1.671,13	(557.750,86)
GNDI3	6.152.146,00	885.628,53	18.469,99	0,12%	49.672,17	192,88	(66.862,43)
HAPV3	11.492.594,00	1.904.397,46	(37.232,69)	-0,25%	12.018,49	46,83	(16.311,79)
IFCM3	3.190.140,00	4.089,55	196,10	0,00%	-	-	-
INTB3	3.625.364,00	382.450,88	103.783,13	0,68%	288.474,25	-	(358.233,19)
ITSA4	11.018.965,00	952.460,90	500.765,04	3,30%	2.134.117,59	7.608,04	(2.356.140,99)
ITUB4	25.865.394,06	2.450.190,28	1.002.532,21	6,61%	4.838.643,53	17.298,70	(5.376.750,17)
JBSS3	14.267.130,00	1.942.235,62	200.262,77	1,32%	254.768,83	984,53	(339.056,50)
LAME4	1.850.501,00	592.243,50	42.199,04	0,28%	(278.876,73)	(1.178,08)	459.916,28
LTRE3	8.715.657,50	971.349,56	227.313,23	1,50%	59.078,33	229,55	(79.644,48)
LWSA3	2.987.535,00	988.020,15	102.112,79	0,67%	1.764.032,03	5.409,57	(1.397.295,82)
MGLU3	5.833.620,00	1.272.203,48	355.009,43	2,34%	4.482.841,86	12.980,43	(3.145.276,47)
MOVI3	7.668.460,00	1.422.514,26	645.787,29	4,26%	585.625,12	2.200,49	(729.782,89)
MULT3	4.747.120,00	840.942,35	180.260,57	1,19%	(370.050,31)	(1.501,80)	553.503,75
NTCO3	6.010.588,00	1.525.333,20	48.669,92	0,32%	3.664.139,22	11.164,43	(2.862.818,14)
PETR3	20.847.838,00	2.479.074,95	1.467.764,99	9,67%	2.320.412,55	8.579,30	(2.785.262,60)
PETR4	28.398.743,37	3.669.624,04	2.055.074,21	13,55%	3.658.309,57	13.418,99	(4.311.461,97)
PRI03	4.502.351,00	1.671.484,59	262.475,47	1,73%	1.209.384,24	4.178,23	(1.243.788,42)
RADL3	5.892.654,00	790.180,08	(66.931,79)	-0,44%	(364.929,75)	(1.468,51)	534.817,91
RAPT4	4.044.978,00	430.734,03	241.708,25	1,59%	512.365,71	1.881,22	(605.194,16)
STBP3	6.527.902,00	1.568.347,59	902.776,30	5,95%	3.162.078,06	10.060,68	(2.711.487,59)
SUZB3	12.821.328,00	2.059.116,28	92.085,86	0,61%	(500.445,57)	(1.990,01)	712.791,28



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	393.251.415,85	VAR / PL:	3,858%
VAR:	15.171.454,62	ETL / PL:	4,8380%
ETL:	19.025.622,69	VAR / CDI:	13186,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(294,15)	BAIXA 1:	300,89	Cenário 1:	52.489.140,70
				Cenário 2:	163.757,29
				Cenário 3:	(47.762.414,13)

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
TIMS3	2.419.140,00	362.927,77	143.107,34	0,94%	(304.873,61)	(1.270,11)	485.941,70
TOTS3	8.029.707,27	760.360,37	42.135,16	0,28%	243.141,86	933,91	(318.992,36)
USIM5	6.527.277,00	1.147.818,82	816.700,29	5,38%	3.162.759,69	10.062,31	(2.711.754,77)
VALE3	39.528.395,25	4.224.571,05	2.485.122,60	16,38%	12.944.517,96	43.679,38	(12.629.818,85)
WEGE3	9.330.585,00	1.797.044,94	24.707,36	0,16%	1.878.123,36	6.673,63	(2.058.196,61)
COMPROMISSADA	11.612.396,79	298,26	137,09	0,00%	539,92	(280,78)	(833,39)
Total	394.364.567,24	50.776.686,51	15.171.454,62	100,00%	52.489.140,70	163.757,29	(47.762.414,13)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	92.343.281,76	VAR / PL:	4,669%
VAR:	4.311.548,57	ETL / PL:	5,8552%
ETL:	5.406.857,70	VAR / CDI:	15959,12%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(137,13)	BAIXA 1:	140,27	Cenário 1:	12.225.504,74
				Cenário 2:	35.490,64
				Cenário 3:	(11.704.398,50)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	7.870,98	-	-	0,00%	-	-	-
ALSO3	1.539.944,00	251.896,80	178.614,24	4,14%	115.621,01	434,71	(144.284,86)
AMER3	2.216.392,00	467.045,05	131.689,96	3,05%	161.678,15	-	(202.231,65)
ANIM3	69.336,00	16.759,55	11.800,46	0,27%	37.863,62	117,88	(30.982,21)
ASAI3	497.058,75	104.207,03	(1.315,59)	-0,03%	216.326,39	-	(192.848,19)
B3SA3	2.690.575,36	237.421,92	72.891,38	1,69%	148.815,90	564,76	(189.803,95)
UNT	1.936.950,00	181.924,46	107.277,65	2,49%	460.826,30	1.612,37	(487.638,54)
BBDC4	1.045.275,00	87.829,42	19.281,81	0,45%	62.362,38	236,18	(79.154,95)
BBRK3	19.398,00	3.983,31	(38,98)	0,00%	10.869,07	33,67	(8.800,60)
BBSE3	626.400,00	78.286,58	(22.688,09)	-0,53%	(78.369,94)	(326,33)	124.759,67
BIDI11	405.776,00	81.507,48	50.742,96	1,18%	120.643,90	412,00	(120.891,81)
BMGB4	173.978,00	19.621,73	6.977,08	0,16%	66.486,02	219,66	(61.907,00)
BRAP4	590.283,75	59.125,17	20.634,82	0,48%	134.460,88	472,46	(143.651,50)
BRML3	3.862.444,30	763.907,22	505.524,86	11,72%	26.662,95	103,59	(35.939,52)
CESP6	1.012.079,06	93.743,91	(30.002,54)	-0,70%	(90.149,09)	(368,04)	136.794,61
CPFE3	1.818.960,00	155.145,43	65.213,82	1,51%	1.589,71	6,20	(2.158,03)
CRFB3	1.909.136,88	107.592,62	32.017,28	0,74%	263.860,62	963,80	(307.969,13)
CSED3	143.650,00	33.227,11	21.468,16	0,50%	42.374,10	-	(42.550,09)
CYRE3	1.190.421,60	159.745,96	132.574,90	3,07%	388.209,93	1.310,66	(379.223,35)
ELET3	1.018.056,00	115.469,82	30.968,40	0,72%	272.597,99	942,11	(280.570,95)
ELET6	2.131.325,00	268.991,82	74.113,51	1,72%	660.611,85	2.244,62	(654.562,19)
EQTL3	4.484.659,00	324.596,83	89.597,91	2,08%	470.908,20	1.746,12	(569.023,92)
ESPA3	14.670,00	3.469,37	1.900,11	0,04%	8.390,85	-	(6.736,21)
EUCATEX PN	111.188,00	11.268,72	7.298,16	0,17%	17.886,25	64,68	(20.400,48)
GGBR4	216.720,00	20.227,10	2.674,91	0,06%	14.355,67	54,20	(18.089,22)
GNDI3	682.206,00	98.206,56	45.142,55	1,05%	5.508,10	21,39	(7.414,32)
GOAU4	824.310,00	71.498,32	(4.949,83)	-0,11%	64.705,70	242,89	(80.446,83)
HAPV3	1.104.964,80	183.099,84	77.629,14	1,80%	1.155,53	4,50	(1.568,31)
HBSA3	338.373,31	51.020,79	30.852,84	0,72%	192.841,44	595,50	(155.047,72)
HYPE3	2.918.654,40	252.689,27	136.905,93	3,18%	197.923,78	746,69	(248.967,27)
IGTI11	288.230,00	51.966,08	28.642,89	0,66%	-	-	-
ITSA4	3.608.844,00	311.942,44	35.639,14	0,83%	698.949,26	2.491,72	(771.664,61)
ITUB4	614.554,80	58.215,86	33.673,27	0,78%	114.964,87	411,01	(127.750,14)
LCAM3	977.774,00	192.486,64	151.380,89	3,51%	85.805,14	320,70	(105.614,12)
LREN3	2.208.459,70	246.130,18	142.110,53	3,30%	14.969,85	58,17	(20.181,11)
MDNE3	65.191,00	9.302,33	6.551,47	0,15%	34.182,10	107,23	(28.429,03)
MRVE3	276.141,00	49.186,72	38.362,22	0,89%	20.389,87	76,71	(25.479,35)
NTCO3	4.775.508,25	1.211.901,61	(267.923,07)	-6,21%	2.911.217,19	8.870,32	(2.274.554,78)
OMGE3	1.517.044,58	188.970,29	(19.222,91)	-0,45%	322.050,27	1.139,01	(349.196,01)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	92.343.281,76	VAR / PL:	4,669%
VAR:	4.311.548,57	ETL / PL:	5,8552%
ETL:	5.406.857,70	VAR / CDI:	15959,12%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(137,13)	BAIXA 1:	140,27	Cenário 1:	12.225.504,74
				Cenário 2:	35.490,64
				Cenário 3:	(11.704.398,50)

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
PARD3	676.260,05	128.403,55	(7.570,60)	-0,18%	89.918,67	329,22	(105.518,90)
PETR3	4.684.901,32	557.094,77	75.907,61	1,76%	521.440,34	1.927,93	(625.900,89)
POWE3	63.441,00	7.727,80	2.193,06	0,05%	2.620,58	-	(3.395,28)
PRI03	862.325,00	320.135,62	(82.989,42)	-1,92%	231.630,60	800,25	(238.219,96)
QUAL3	245.388,00	28.670,47	11.092,66	0,26%	36.513,83	132,75	(42.158,37)
RAIL3	3.284.184,40	428.273,53	289.820,01	6,72%	213.569,28	806,78	(269.472,85)
RECV3	1.153.926,00	264.827,41	102.543,48	2,38%	514.334,95	-	(454.668,34)
RENT3	4.265.998,37	786.176,76	604.769,15	14,03%	435.250,38	1.616,10	(527.602,57)
SEER3	617.308,34	86.223,60	24.594,71	0,57%	197.867,57	669,50	(194.234,48)
SOMA3	3.295.531,26	404.148,79	268.354,11	6,22%	857.352,25	2.972,29	(888.626,28)
SULA11	2.547.492,48	398.526,98	57.273,08	1,33%	(332.095,71)	(1.386,88)	532.471,31
SUZB3	5.170.988,16	830.465,14	331.297,40	7,68%	(201.835,42)	(802,59)	287.476,87
SYNE3	377.235,00	74.869,83	(15.050,76)	-0,35%	(108.847,88)	-	221.901,27
TEND3	1.884.528,00	359.615,03	139.429,86	3,23%	(180.549,59)	(739,80)	276.392,57
USIM5	987.993,00	173.738,14	65.119,28	1,51%	478.727,11	1.523,07	(410.461,32)
VALE3	902.355,00	96.438,59	21.531,12	0,50%	295.497,72	997,11	(288.313,76)
VBBR3	4.889.384,96	455.170,35	386.358,56	8,96%	652.985,68	-	(765.809,34)
WEST3	52.470,00	46.971,75	15.300,02	0,35%	80.372,77	-	(37.621,08)
YDUQ3	1.032.559,00	123.817,45	77.512,14	1,80%	240.954,10	844,67	(256.070,98)
COMPROMISSADA	5.413.624,95	139,05	50,86	0,00%	251,71	(130,90)	(388,52)
Total	92.341.697,81	12.195.045,96	4.311.548,57	100,00%	12.225.504,74	35.490,64	(11.704.398,50)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIA RVA EMB IV CNPJ - 38452613000132

Dados Gerais

PL:	89.149.300,84	VAR / PL:	7,797%
VAR:	6.950.970,46	ETL / PL:	9,7778%
ETL:	8.716.800,37	VAR / CDI:	26650,69%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(169,20)	BAIXA 1:	173,07	Cenário 1:	13.044.888,69
				Cenário 2:	37.838,81
				Cenário 3:	(12.837.376,41)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	570.472,45	-	-	0,00%	-	-	-
UNT	5.161.542,48	484.788,37	263.678,45	3,79%	1.227.999,95	4.296,60	(1.299.448,63)
BIDI11	1.560.172,49	313.388,98	14.544,70	0,21%	463.865,02	1.584,09	(464.818,21)
BIDI3	938,96	-	-	0,00%	-	-	-
BIDI4	13.204,75	2.371,33	307,91	0,00%	4.114,85	13,97	(4.071,16)
BRML3	4.740.616,20	937.590,47	(406.571,66)	-5,85%	32.725,09	127,15	(44.110,79)
CESP6	3.924.569,62	363.513,59	(11.376,13)	-0,16%	(349.573,85)	(1.427,17)	530.452,59
CLSA3	3.051.815,00	128.915,12	64.884,78	0,93%	-	-	-
ELET3	1.922.200,67	218.019,60	177.393,89	2,55%	514.694,72	1.778,80	(529.748,53)
ELET6	965.121,65	121.806,78	106.319,84	1,53%	299.142,93	1.016,43	(296.403,48)
EQTL3	7.416.456,86	536.798,54	411.167,51	5,92%	778.759,40	2.887,62	(941.017,22)
ESPA3	1.842.983,95	435.854,72	183.961,22	2,65%	1.054.138,31	-	(846.265,98)
GGPS3	3.534.258,74	356.786,74	214.907,22	3,09%	639.034,51	-	(714.498,04)
GMAT3	5.522.153,42	1.341.072,57	785.056,55	11,29%	1.676.148,99	5.709,79	(1.670.299,36)
GNDI3	4.395.865,04	632.804,15	(97.458,15)	-1,40%	35.492,03	137,82	(47.774,91)
HAPV3	1.565.301,34	259.380,60	(37.281,84)	-0,54%	1.636,93	6,38	(2.221,68)
INTB3	1.760.451,28	185.715,46	109.059,64	1,57%	140.081,07	-	(173.955,52)
MATD3	2.932.065,06	1.031,13	(325,48)	0,00%	-	-	-
MULT3	2.192.867,60	388.461,90	(214.463,78)	-3,09%	(170.939,71)	(693,73)	255.683,54
NCO3	4.263.300,46	1.081.916,40	753.812,69	10,84%	2.598.968,09	7.918,92	(2.030.592,33)
OMGE3	1.614.857,14	201.154,29	136.182,46	1,96%	342.814,69	1.212,45	(371.710,68)
PETR4	6.216.528,33	803.286,31	373.803,95	5,38%	800.809,56	2.937,44	(943.785,61)
PRI03	5.539.900,44	2.056.671,77	1.391.927,05	20,02%	1.488.082,18	5.141,09	(1.530.414,67)
RAIL3	9.871.845,06	1.287.336,35	(323.428,20)	-4,65%	641.962,38	2.425,07	(810.001,47)
UGPA3	4.055.565,93	574.145,09	26.579,26	0,38%	824.621,01	2.927,61	(901.894,91)
VITT3	372.775,60	3.658.813,97	3.028.223,14	43,57%	-	-	-
COMPROMISSADA	6.679.428,78	171,56	65,45	0,00%	310,56	(161,51)	(479,36)
Total	91.688.259,30	16.371.795,78	6.950.970,46	100,00%	13.044.888,69	37.838,81	(12.837.376,41)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIA RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	7.334.604,88	VAR / PL:	3,025%
VAR:	221.850,91	ETL / PL:	3,7931%
ETL:	278.210,09	VAR / CDI:	10338,69%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(2,88)	BAIXA 1:	2,94	Cenário 1:	754.459,36
				Cenário 2:	2.322,52
				Cenário 3:	(712.839,64)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.905.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	116.369,39	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	192.720,00	33.869,33	(7.786,71)	-3,51%	(40.933,25)	(179,31)	73.864,57
ALPA4	15.636,00	2.259,09	432,89	0,20%	4.995,02	16,91	(4.907,95)
AMER3	43.600,16	9.187,56	1.425,79	0,64%	3.180,48	-	(3.978,24)
ASAI3	26.775,00	5.613,31	997,64	0,45%	11.652,83	-	(10.388,13)
AZUL4	21.042,00	4.057,98	2.096,06	0,94%	11.111,19	34,81	(9.215,31)
B3SA3	182.204,00	16.078,06	(1.247,22)	-0,56%	10.077,71	38,25	(12.853,40)
UNT	73.290,00	6.883,63	4.046,93	1,82%	17.436,67	61,01	(18.451,19)
BBAS3	117.808,00	12.015,06	9.214,49	4,15%	5.693,02	21,68	(7.317,97)
BBDC3	62.803,80	5.087,57	2.003,00	0,90%	3.236,80	12,31	(4.145,72)
BBDC4	250.666,90	21.062,33	7.399,46	3,34%	14.955,09	56,64	(18.982,11)
BBSE3	39.672,00	4.958,15	(1.331,42)	-0,60%	(4.963,43)	(20,67)	7.901,45
BEEF3	5.148,00	925,26	405,89	0,18%	829,39	3,00	(945,74)
BIDI11	47.099,00	9.460,69	2.271,27	1,02%	14.003,31	47,82	(14.032,08)
BIDI4	5.975,00	1.073,00	309,34	0,14%	1.861,92	6,32	(1.842,15)
BPAN4	10.134,00	1.864,61	1.107,82	0,50%	6.363,45	19,27	(4.907,76)
BRAP4	33.382,25	3.343,70	2.151,52	0,97%	7.604,15	26,72	(8.123,91)
BRFS3	43.450,00	6.200,18	2.894,79	1,30%	10.566,83	36,89	(11.126,35)
BRKM5	35.035,00	6.332,64	2.335,31	1,05%	11.351,17	38,36	(11.108,96)
BRML3	17.380,00	3.437,38	1.018,17	0,46%	119,98	0,47	(161,72)
CASH3	4.186,00	1.330,84	210,16	0,09%	3.330,93	-	(2.296,65)
CCRO3	36.930,00	2.950,48	1.827,26	0,82%	2.528,30	9,54	(3.178,07)
CIEL3	6.417,00	870,64	183,25	0,08%	884,57	3,23	(1.032,82)
CMIG4	39.275,46	5.464,50	3.199,91	1,44%	5.226,65	19,14	(6.132,72)
COGN3	12.152,00	1.280,83	789,75	0,36%	2.602,34	9,20	(2.816,65)
CPFE3	13.200,00	1.125,87	222,49	0,10%	11,54	0,04	(15,66)
CPLE6	25.788,00	3.116,16	1.650,75	0,74%	3.708,69	13,51	(4.303,84)
CRFB3	16.863,00	950,34	576,40	0,26%	2.330,62	8,51	(2.720,23)
CSAN3	68.000,00	7.918,03	4.673,18	2,11%	12.134,75	43,55	(13.599,47)
CSNA3	39.168,00	4.701,24	2.983,60	1,34%	20.104,37	63,31	(16.861,21)
CVCB3	8.172,00	1.690,50	879,20	0,40%	4.275,25	13,42	(3.558,86)
CYRE3	10.880,00	1.460,02	908,60	0,41%	3.548,09	11,98	(3.465,96)
DXCO3	14.424,00	2.015,34	1.137,50	0,51%	1.350,64	-	(1.651,97)
ECOR3	7.470,00	738,22	490,92	0,22%	1.064,47	3,88	(1.236,96)
EGIE3	26.971,00	1.268,92	(265,56)	-0,12%	(1.599,83)	(6,43)	2.336,90
ELET3	32.630,00	3.700,96	2.302,78	1,04%	8.737,12	30,20	(8.992,66)
ELET6	22.435,00	2.831,49	1.752,27	0,79%	6.953,81	23,63	(6.890,13)
ENBR3	14.980,00	1.110,64	14,27	0,01%	(2.337,04)	(9,90)	3.883,07
ENEV3	47.430,00	4.877,34	306,99	0,14%	1.403,71	5,39	(1.843,06)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIA RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	7.334.604,88	VAR / PL:	3,025%
VAR:	221.850,91	ETL / PL:	3,7931%
ETL:	278.210,09	VAR / CDI:	10338,69%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(2,88)	BAIXA 1:	2,94	Cenário 1:	754.459,36
				Cenário 2:	2.322,52
				Cenário 3:	(712.839,64)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
ENG11	31.843,00	3.820,94	2.769,05	1,25%	2.796,00	10,45	(3.441,30)
EQTL3	60.939,00	4.410,73	1.062,47	0,48%	6.398,85	23,73	(7.732,08)
EZTC3	5.442,00	707,10	455,78	0,21%	1.961,06	6,53	(1.859,90)
FLRY3	13.976,00	1.252,01	197,99	0,09%	2.054,46	7,47	(2.376,41)
GGBR4	77.400,00	7.223,97	3.377,75	1,52%	5.127,02	19,36	(6.460,43)
GNDI3	92.190,00	13.271,16	(1.067,21)	-0,48%	744,34	2,89	(1.001,93)
GOAU4	20.235,00	1.755,13	623,98	0,28%	1.588,38	5,96	(1.974,79)
GOLL4	7.616,00	1.328,62	750,85	0,34%	2.539,62	8,55	(2.464,99)
HAPV3	37.094,00	6.146,72	(738,71)	-0,33%	38,79	0,15	(52,65)
HYPE3	29.832,00	2.582,77	77,61	0,03%	2.023,01	7,63	(2.544,73)
IGTI11	8.930,00	1.610,02	391,23	0,18%	-	-	-
IRBR3	14.223,00	2.165,40	443,49	0,20%	3.272,01	11,49	(3.488,18)
ITSA4	117.974,00	10.197,48	5.855,98	2,64%	22.848,82	81,46	(25.225,91)
ITUB4	288.702,00	27.348,31	8.984,93	4,05%	54.007,53	193,08	(60.013,72)
JBSS3	131.905,00	17.956,70	2.341,39	1,06%	2.355,43	9,10	(3.134,71)
JHSF3	3.760,00	303,13	166,10	0,07%	800,30	2,83	(867,29)
KLBN11	52.514,00	4.251,97	(680,26)	-0,31%	(474,72)	(1,86)	652,05
LAME4	12.581,00	4.026,49	100,14	0,05%	(1.896,00)	(8,01)	3.126,83
LCAM3	20.853,00	4.105,17	1.802,51	0,81%	1.829,97	6,84	(2.252,43)
LEN3	77.668,50	8.656,06	1.240,55	0,56%	526,47	2,05	(709,74)
LWSA3	14.509,00	4.798,33	423,06	0,19%	8.567,04	26,27	(6.785,98)
MGLU3	62.400,00	13.608,27	3.503,82	1,58%	47.951,24	138,85	(33.643,82)
MRFG3	21.213,00	3.961,75	950,19	0,43%	529,29	2,04	(698,66)
MRVE3	8.872,00	1.580,30	451,65	0,20%	655,10	2,46	(818,61)
MULT3	15.680,00	2.777,68	471,60	0,21%	(1.222,30)	(4,96)	1.828,25
NTCO3	61.387,00	15.578,45	590,00	0,27%	37.422,38	114,02	(29.238,37)
PACUCAR_CBD ON ED	8.960,00	1.337,65	666,68	0,30%	2.621,10	8,97	(2.637,77)
PETR3	277.288,00	32.973,09	22.148,28	9,98%	30.862,80	114,11	(37.045,56)
PETR4	361.989,00	46.775,43	30.160,07	13,59%	46.631,21	171,05	(54.956,72)
PETZ3	12.747,00	2.127,64	887,31	0,40%	3.384,91	11,71	(3.491,01)
PRIO3	46.667,00	17.324,99	3.462,19	1,56%	12.535,30	43,31	(12.891,90)
QUAL3	12.584,00	1.470,28	(130,70)	-0,06%	1.872,50	6,81	(2.161,97)
RADL3	64.902,00	8.703,08	(1.355,11)	-0,61%	(4.019,36)	(16,17)	5.890,51
RAIL3	57.981,00	7.561,00	3.867,35	1,74%	3.770,48	14,24	(4.757,44)
RDOR3	45.153,00	6.719,42	1.112,72	0,50%	15.110,89	-	(14.651,54)
RENT3	86.887,00	16.012,32	6.981,84	3,15%	8.864,89	32,92	(10.745,86)
SBSP3	30.312,00	3.313,73	1.745,63	0,79%	4.335,52	15,80	(5.035,30)
SOMA3	14.803,74	1.815,46	962,63	0,43%	3.851,28	13,35	(3.991,77)
SULA11	19.968,00	3.123,77	(951,51)	-0,43%	(2.603,06)	(10,87)	4.173,67
SUZB3	112.320,00	18.038,69	312,64	0,14%	(4.384,10)	(17,43)	6.244,34



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIA RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	7.334.604,88	VAR / PL:	3,025%
VAR:	221.850,91	ETL / PL:	3,7931%
ETL:	278.210,09	VAR / CDI:	10338,69%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(2,88)	BAIXA 1:	2,94	Cenário 1:	754.459,36
				Cenário 2:	2.322,52
				Cenário 3:	(712.839,64)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
TAAE11	21.618,00	1.202,12	354,56	0,16%	775,79	2,97	(1.011,33)
TIMS3	28.980,00	4.347,68	1.641,46	0,74%	(3.652,22)	(15,22)	5.821,32
TOTS3	44.366,00	4.201,17	(191,52)	-0,09%	1.343,42	5,16	(1.762,51)
UGPA3	41.847,00	5.924,27	3.864,88	1,74%	8.508,78	30,21	(9.306,12)
USIM5	19.026,00	3.345,71	2.571,19	1,16%	9.218,95	29,33	(7.904,34)
VALE3	629.550,00	67.282,74	45.781,97	20,64%	206.161,20	695,66	(201.149,13)
VBBR3	69.632,00	6.482,29	3.851,31	1,74%	9.299,47	-	(10.906,25)
VIIA3	24.381,00	4.036,02	2.794,42	1,26%	13.270,20	-	(10.873,03)
VIVT3	60.348,00	5.994,78	955,90	0,43%	(11.176,51)	(48,17)	19.366,31
WEGE3	128.920,00	24.829,64	630,81	0,28%	25.949,89	92,21	(28.437,95)
YDUQ3	17.464,00	2.094,16	1.589,65	0,72%	4.075,33	14,29	(4.331,01)
COMPROMISSADA	113.577,46	2,92	1,59	0,00%	5,28	(2,75)	(8,15)
Total	7.334.571,66	665.576,60	221.850,91	100,00%	754.459,36	2.322,52	(712.839,64)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	95.459.396,54	VAR / PL:	4,238%
VAR:	4.045.468,00	ETL / PL:	5,3145%
ETL:	5.073.181,82	VAR / CDI:	14485,42%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(648,41)	BAIXA 1:	809,41	Cenário 1:	13.767.264,31
				Cenário 2:	41.986,13
				Cenário 3:	(13.059.324,82)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	129.886,99	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	3.392.915,90	596.283,75	(138.694,33)	-3,43%	(720.646,97)	(3.156,83)	1.300.416,45
ALPA4	317.137,17	45.819,94	8.698,21	0,22%	101.311,50	342,94	(99.545,41)
AMER3	802.054,96	169.011,53	25.993,16	0,64%	58.507,14	-	(73.182,40)
ASAI3	490.020,75	102.731,54	18.319,36	0,45%	213.263,36	-	(190.117,59)
AZUL4	370.198,92	71.393,38	36.793,98	0,91%	195.482,92	612,44	(162.127,97)
B3SA3	3.272.639,37	288.784,45	(23.865,68)	-0,59%	181.009,89	686,94	(230.865,07)
UNT	1.321.334,94	124.103,95	72.741,42	1,80%	314.363,24	1.099,91	(332.653,83)
BBAS3	2.192.597,92	223.619,72	171.379,97	4,24%	105.956,41	403,45	(136.199,27)
BBDC3	1.138.042,30	92.189,79	36.434,95	0,90%	58.652,77	222,99	(75.122,97)
BBDC4	4.526.976,52	380.380,02	134.664,95	3,33%	270.084,95	1.022,87	(342.811,78)
BBSE3	677.409,84	84.661,72	(22.781,95)	-0,56%	(84.751,87)	(352,90)	134.919,26
BEEF3	101.235,42	18.195,20	7.940,98	0,20%	16.309,89	58,97	(18.597,97)
BIDI11	840.572,23	168.844,20	39.885,68	0,99%	249.915,99	853,46	(250.429,54)
BIDI4	108.350,65	19.457,75	5.533,01	0,14%	33.764,09	114,65	(33.405,61)
BPAN4	185.902,60	34.205,14	20.384,17	0,50%	116.733,90	353,52	(90.030,17)
BRAP4	602.024,75	60.301,19	38.815,36	0,96%	137.135,36	481,85	(146.508,79)
BRFS3	777.419,25	110.935,33	51.716,04	1,28%	189.064,61	660,06	(199.075,67)
BRKM5	639.238,60	115.543,55	42.908,42	1,06%	207.110,13	699,82	(202.690,85)
BRML3	324.002,70	64.080,67	18.701,19	0,46%	2.236,63	8,69	(3.014,80)
CASH3	78.819,39	25.058,76	3.805,88	0,09%	62.718,95	-	(43.244,36)
CCRO3	665.306,26	53.153,90	32.828,95	0,81%	45.548,25	171,78	(57.254,04)
CIEL3	114.818,76	15.578,36	3.273,43	0,08%	15.827,46	57,82	(18.480,15)
CMIG4	709.468,02	98.710,22	57.854,47	1,43%	94.413,60	345,66	(110.780,85)
COGN3	221.868,24	23.385,06	14.390,63	0,36%	47.512,82	167,91	(51.425,65)
CPFE3	240.715,20	20.531,44	4.013,72	0,10%	210,38	0,82	(285,59)
CPLE6	465.276,92	56.222,95	29.802,10	0,74%	66.913,53	243,80	(77.651,55)
CRFB3	305.281,62	17.204,66	10.453,90	0,26%	42.192,78	154,12	(49.245,98)
CSAN3	1.206.298,75	140.463,31	82.229,14	2,03%	215.266,72	772,48	(241.250,35)
CSNA3	676.409,60	81.187,88	51.534,00	1,27%	347.191,36	1.093,38	(291.183,75)
CVCB3	147.681,66	30.550,09	15.812,73	0,39%	77.260,83	242,47	(64.314,57)
CYRE3	186.143,20	24.979,07	15.438,59	0,38%	60.703,40	204,94	(59.298,19)
DXCO3	238.663,11	33.346,40	18.793,92	0,46%	22.348,09	-	(27.333,83)
ECOR3	136.476,90	13.487,31	8.904,80	0,22%	19.447,91	70,90	(22.599,23)
EGIE3	479.159,08	22.543,34	(4.755,67)	-0,12%	(28.422,06)	(114,22)	41.516,62
ELET3	565.282,12	64.115,36	39.898,36	0,99%	151.361,78	523,11	(155.788,82)
ELET6	378.190,00	47.730,88	29.550,94	0,73%	117.221,35	398,29	(116.147,88)
ENBR3	241.584,60	17.911,47	182,38	0,00%	(37.689,75)	(159,70)	62.622,82
ENEV3	853.335,45	87.750,44	4.864,07	0,12%	25.254,86	97,04	(33.159,31)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	95.459.396,54	VAR / PL:	4,238%
VAR:	4.045.468,00	ETL / PL:	5,3145%
ETL:	5.073.181,82	VAR / CDI:	14485,42%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(648,41)	BAIXA 1:	809,41	Cenário 1:	13.767.264,31
				Cenário 2:	41.986,13
				Cenário 3:	(13.059.324,82)

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
ENGI11	545.789,02	65.490,97	47.393,00	1,17%	47.923,44	179,11	(58.983,85)
EQTL3	1.105.546,31	80.018,76	19.206,29	0,47%	116.087,05	430,45	(140.274,28)
EZTC3	89.539,04	11.634,11	7.466,47	0,18%	32.265,97	107,49	(30.601,51)
FLRY3	255.935,50	22.927,47	3.537,27	0,09%	37.622,23	136,88	(43.517,92)
GETT11	16.511,00	9.421,38	4.410,00	0,11%	33.451,63	-	(12.843,95)
GGBR4	1.372.508,40	128.100,17	60.164,74	1,49%	90.915,82	343,25	(114.560,73)
GNDI3	1.757.448,70	252.992,49	(21.625,51)	-0,53%	14.189,57	55,10	(19.100,21)
GOAU4	360.001,95	31.225,55	11.190,45	0,28%	28.259,00	106,08	(35.133,65)
GOLL4	129.312,00	22.558,59	12.677,15	0,31%	43.120,13	145,16	(41.853,00)
HAPV3	691.573,99	114.598,30	(14.330,29)	-0,35%	723,22	2,82	(981,57)
HYPE3	543.566,16	47.060,50	1.193,19	0,03%	36.861,05	139,06	(46.367,32)
IGTI11	126.160,00	22.745,86	5.424,93	0,13%	-	-	-
IRBR3	262.250,57	39.926,73	8.289,89	0,20%	60.330,94	211,78	(64.316,69)
ITSA4	2.116.550,26	182.951,06	105.811,22	2,62%	409.926,63	1.461,37	(452.573,43)
ITUB4	5.186.385,96	491.298,62	160.376,61	3,96%	970.218,08	3.468,64	(1.078.116,25)
JBSS3	2.328.729,30	317.018,28	42.095,29	1,04%	41.584,23	160,70	(55.341,95)
JHSF3	69.348,50	5.590,84	3.042,53	0,08%	14.760,58	52,19	(15.996,16)
KLBN11	941.122,49	76.201,13	(12.236,76)	-0,30%	(8.507,65)	(33,32)	11.685,56
LAME4	226.255,61	72.411,97	1.570,19	0,04%	(34.097,48)	(144,04)	56.232,68
LCAM3	364.186,06	71.694,43	31.095,22	0,77%	31.959,36	119,45	(39.337,50)
LREN3	1.349.042,10	150.349,12	20.750,40	0,51%	9.144,36	35,53	(12.327,67)
LWSA3	276.409,64	91.412,58	8.218,27	0,20%	163.209,96	500,50	(129.279,17)
MGLU3	1.066.018,20	232.478,64	60.073,56	1,48%	819.181,06	2.372,01	(574.758,38)
MRFG3	399.865,05	74.679,02	18.041,95	0,45%	9.977,16	38,42	(13.169,81)
MRVE3	159.163,68	28.350,51	7.922,10	0,20%	11.752,43	44,21	(14.685,93)
MULT3	260.444,80	46.137,25	7.615,56	0,19%	(20.302,35)	(82,39)	30.367,29
NTCO3	1.094.770,42	277.824,68	11.046,92	0,27%	667.387,49	2.033,49	(521.434,61)
PACUCAR_CBD ON ED	170.665,60	25.478,90	12.778,80	0,32%	49.925,35	170,82	(50.243,00)
PETR3	5.005.590,92	595.228,87	402.579,60	9,95%	557.133,84	2.059,90	(668.744,89)
PETR4	6.515.654,85	841.938,79	546.820,80	13,52%	839.342,86	3.078,78	(989.198,63)
PETZ3	248.821,44	41.531,52	17.263,32	0,43%	66.073,45	228,56	(68.144,56)
PRI03	824.788,50	306.200,31	62.002,72	1,53%	221.547,86	765,41	(227.850,38)
QUAL3	216.444,80	25.288,83	(2.412,35)	-0,06%	32.207,07	117,09	(37.185,84)
RADL3	1.160.268,72	155.587,15	(24.936,07)	-0,62%	(71.854,99)	(289,15)	105.306,11
RAIL3	1.035.523,09	135.037,22	68.673,15	1,70%	67.339,68	254,38	(84.966,41)
RDOR3	780.845,88	116.201,13	19.584,60	0,48%	261.317,68	-	(253.373,89)
RENT3	1.464.863,71	269.958,33	116.261,54	2,87%	149.456,81	554,94	(181.168,81)
SANB11	579.766,40	36.319,46	14.046,85	0,35%	31.090,81	118,09	(39.728,60)
SBSP3	554.743,28	60.644,97	31.981,78	0,79%	79.344,75	289,20	(92.151,65)
SOMA3	263.420,64	32.304,69	17.013,91	0,42%	68.530,46	237,58	(71.030,28)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	95.459.396,54	VAR / PL:	4,238%
VAR:	4.045.468,00	ETL / PL:	5,3145%
ETL:	5.073.181,82	VAR / CDI:	14485,42%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(648,41)	BAIXA 1:	809,41	Cenário 1:	13.767.264,31
				Cenário 2:	41.986,13
				Cenário 3:	(13.059.324,82)

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
SULA11	344.472,96	53.888,98	(16.601,81)	-0,41%	(44.906,12)	(187,53)	72.000,99
SUZB3	1.983.627,36	318.572,26	4.815,56	0,12%	(77.425,48)	(307,88)	110.278,15
TAAE11	382.458,45	21.267,42	6.333,69	0,16%	13.725,06	52,58	(17.892,07)
TIMS3	541.650,00	81.260,21	30.334,61	0,75%	(68.261,78)	(284,38)	108.803,26
TOTS3	799.570,39	75.714,05	(3.770,61)	-0,09%	24.211,22	93,00	(31.764,15)
UGPA3	757.979,04	107.306,83	69.653,16	1,72%	154.120,40	547,17	(168.562,77)
USIM5	338.689,98	59.558,49	45.843,08	1,13%	164.110,55	522,12	(140.708,62)
VALE3	11.466.973,45	1.225.525,19	838.375,29	20,72%	3.755.134,58	12.671,15	(3.663.842,07)
VBBR3	1.227.285,76	114.252,43	67.395,90	1,67%	163.906,10	-	(192.226,00)
VIIA3	438.512,13	72.591,18	50.367,99	1,25%	238.675,40	-	(195.560,27)
VIVT3	1.081.184,71	107.401,46	16.833,88	0,42%	(200.236,50)	(862,98)	346.963,55
WEGE3	2.319.528,64	446.734,82	11.915,84	0,29%	466.890,44	1.659,03	(511.655,59)
YDUQ3	318.128,59	38.147,82	28.901,55	0,71%	74.237,30	260,24	(78.894,77)
INDZ21	920.412,00	39.052,19	38.529,92	0,95%	132.840,90	-	(154.077,80)
COMPROMISSADA	1.120.539,22	28,78	15,73	0,00%	52,10	(27,09)	(80,42)
EMP AÇÃO PROVISÃO	7.689,75	2,13	1,09	0,00%	4,40	(2,28)	(6,77)
LFT	300.910,96	59,03	(1,35)	0,00%	0,01	(0,00)	(0,01)
Total	96.395.186,59	12.014.636,16	4.045.468,00	100,00%	13.767.264,31	41.986,13	(13.059.324,82)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 30/11/2021

FIM EMB V A INVEST NO EXT CNPJ - 41252756000105

Dados Gerais

PL:	81.082.761,34	VAR / PL:	22,554%
VAR:	18.287.714,07	ETL / PL:	28,2841%
ETL:	22.933.539,09	VAR / CDI:	77092,44%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	8.299.046,80	BAIXA 1:	(8.629.732,53)	Cenário 1:	(2.477.821,63)
				Cenário 2:	(636.301,08)
				Cenário 3:	4.166.985,86

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	129.772,66	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(30.852,59)	-	-	0,00%	-	-	-
EWJ_US	4.430.929,23	183.108,81	46.006,53	0,25%	(70.304,44)	(39.878,36)	97.356,82
SPY	12.581.713,26	519.941,17	130.636,47	0,71%	(199.630,88)	(113.235,42)	276.446,67
VTV_US	6.967.633,79	287.938,50	72.345,24	0,40%	(110.553,69)	(62.708,70)	153.093,55
COMPROMISSADA	218.645,17	5,62	(3,33)	0,00%	10,17	(5,29)	(15,69)
LFT	11.037,94	4,73	0,07	0,00%	0,00	(0,00)	(0,00)
AB AMERICAN GROWTH	9.909.033,15	617.898,47	87.378,69	0,48%	(1.361.708,53)	(89.181,30)	2.204.590,13
FUNDSMITH EQ FUND	10.932.893,85	532.632,03	142.833,69	0,78%	(886.876,20)	(98.396,04)	1.331.969,13
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.472.638,81	55.145,30	8.427,41	0,05%	-	-	-
LOOMIS US GROWTH	8.114.999,49	14.405.343,52	14.290.290,84	78,14%	1.126.258,26	(73.035,00)	(1.313.749,67)
EUROPEA	6.924.139,00	498.619,70	250.256,29	1,37%	(334.302,52)	(62.317,25)	481.628,33
PICTET GL FIC FIM IE	3.780.388,53	31.982,21	5.036,65	0,03%	-	-	-
QUAL	10.838.191,31	3.260.423,48	3.254.505,52	17,80%	(640.713,80)	(97.543,72)	935.666,60
Total	79.281.163,59	20.393.043,53	18.287.714,07	100,00%	(2.477.821,63)	(636.301,08)	4.166.985,86



3. RISCO DE CRÉDITO

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

3.1. Relatório de Risco de Crédito



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/11/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VI A CRED PRIV	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	5.106.518,04	BRLCAMDBS0R2	brAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	23/09/21	14/08/23	ABC	1.024.139,10	BRABCLF13Q1	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	15/03/24	CCPR	2.031.343,02	BRCCPRDBS0D1	-	Ab.r	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	20/05/25	CEAMODA	2.014.638,78	BRCEABDBS011	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	15/03/24	AMPL	2.035.626,58	BRCBEEEDBS0D0	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.015.288,77	BRBPANLF1654	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	28/05/23	IGUATEMI	2.289.181,94	BRIGTADBS080	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	15/01/26	LOCAMERI	1.877.354,28	BRLCAMDBS009	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	05/03/24	ENERG TR	2.027.742,45	BRETENDBS061	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	10/08/23	PARANAB	1.024.417,26	BRPRBCLFICE4	brAAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	01/04/24	CNH	1.882.353,13	BRCNHCLF1317	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	10/05/27	SABESP	1.139.045,52	BRSBSPDBS1B5	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	776.239,30	BRSIMHDBS044	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/09/21	15/01/31	SIMPAP	1.011.825,54	BRSIMHDBS036	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	1.770.418,76	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	1.818.923,39	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/10/21	15/12/31	METRORIO	571.609,32	BRMGPRDBS068	brAAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.048.523,18	BRTCIDBS009	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	19/10/21	15/06/30	ECHOENER	1.120.212,68	BRECHPDBS008	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.070.245,37	BRDAYCLFNKX1	brAAA	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.159.811,84	BRDAYCLFNKX3	brAAA	AA.br	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	15/12/35	CART	2.581.383,42	BRRPTADBS033	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	22/10/21	15/12/35	CART	1.548.830,05	BRRPTADBS033	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/10/21	15/03/26	VIX LOGI	1.014.460,21	BRVIXLDBS047	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/10/21	15/06/39	ANEMUS	249.683,52	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/10/21	15/06/39	ANEMUS	252.926,17	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/10/21	15/06/39	ANEMUS	270.220,26	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/10/21	15/06/39	ANEMUS	249.683,52	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.224.781,74	BRCGBPDBS014	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	777.407,57	BRHARGDBS003	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	6.178.073,42	BRHARGDBS003	brAAA	-	-
FIM EMB I A	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.215.826,56	BRTOYLF12F4	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/10/21	15/06/39	ANEMUS	1.080.881,05	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/10/21	15/10/31	ENERGISA	2.878.716,47	BRENGIDBS000	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/10/21	15/10/31	CELP	2.079.186,12	BRCEPEDBS0G7	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/10/21	15/10/31	ELEKTRO	2.079.189,48	BREKTRDBS0L8	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/10/21	15/10/31	COELBA	2.079.175,54	BRCEEBDBS019	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	03/11/21	15/06/32	ENSINOP	1.546.980,85	BRCSPNDBS022	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/11/21	15/07/39	UTE GNA	3.085.376,97	BRUNEGDBS007	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/11/21	15/10/28	LIGHT	1.508.747,26	BRLIGHDBS020	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.026.282,86	BRVAMODBS074	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	3.961.332,44	BRHBSADBS010	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	15/06/39	ANEMUS	5.129.861,45	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	15/07/29	GUARIROB	2.009.449,50	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	15/05/26	OMEGA GE	1.120.664,65	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	15/04/26	ECORODOV	2.006.360,40	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	15/06/39	ANEMUS	2.103.394,52	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	15/03/28	BRISANET	809.331,01	BRBRSTDBS001	brA+	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC VERDECARD SN6	1.400.538,68	BRVDCRCTF057	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC VERDECARD SN5	700.255,73	BRVDCRCTF040	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC VERDECARD SN3	4.938.615,08	BRVDCRCTF024	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.097.695,92	BRCRDZCTF0A0	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CREDZ SN4	13.875,41	BRCRDZCTF074	-	-	AAAsf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CELG DIST SN B	3.436.173,87	BRFCLGCTF015	-	-	AA-sf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SANEAGOIFR IV 1 FIDC	2.788.108,90	BRNGSCTF002	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FARM SYN AGRO FIDC	3.207.365,61	BR032XCTF002	-	-	AAAsf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	BR ELETRO FIDC S1	4.828.958,88	BR0402CTF000	-	-	Aastf(bra)

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



4. RISCO OPERACIONAL

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

5. RISCO DE LIQUIDEZ

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

6. RISCO LEGAL

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

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **3.765.582.609,13**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.851.157.558,07	3.765.582.609,13	75,72%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACE	100,00%	2.046.514.802,79	3.765.582.609,13	54,35%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	804.642.755,28	3.012.466.132,19	21,37%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	753.116.533,05	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	376.558.266,52	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	941.395.652,28	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	941.395.652,28	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	659.278.903,96	2.635.907.781,50	17,51%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	941.395.652,28	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	92.922.094,50	753.116.533,05	2,47%	Enquadrado

(*) O Relatório Completo de Enquadramentos Legais está disponível no portal da EMBRAER PREV (www.embraerprev.com.br)



6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE NOVEMBRO DE 2021 À 30 DE NOVEMBRO DE 2021



Bradesco

FIM EMB I A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
03/11/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Compra	4,9524%	4,9544%	4,5319%	5,3422%	-0,0020%	NÃO
08/11/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Compra	4,9091%	4,8950%	4,4789%	5,3118%	0,0141%	NÃO
09/11/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Venda	5,2011%	4,8000%	4,4499%	5,2870%	0,4011%	NÃO
09/11/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Venda	5,2011%	4,8000%	4,4499%	5,2870%	0,4011%	NÃO
09/11/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Venda	5,2011%	4,8000%	4,4499%	5,2870%	0,4011%	NÃO
09/11/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Venda	5,2011%	4,8000%	4,4499%	5,2870%	0,4011%	NÃO
09/11/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Venda	5,2011%	4,8000%	4,4499%	5,2870%	0,4011%	NÃO
09/11/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Venda	5,2011%	4,8000%	4,4499%	5,2870%	0,4011%	NÃO
09/11/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Venda	5,2011%	4,8000%	4,4499%	5,2870%	0,4011%	NÃO
09/11/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Venda	5,2011%	4,8000%	4,4499%	5,2870%	0,4011%	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
03/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,5511%	5,4630%	5,2206%	5,8799%	0,0881%	NÃO
03/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,5090%	5,2170%	4,9251%	5,7557%	0,2920%	NÃO
04/11/2021	FIM EMB II A	BNP	GUIDE CT	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,5810%	5,4900%	5,2201%	5,7934%	0,0910%	NÃO
04/11/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,6110%	5,4900%	5,2201%	5,7934%	0,1210%	NÃO
10/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	5,4255%	5,4400%	5,1832%	5,7553%	-0,0145%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Compra	5,1495%	5,2100%	4,9076%	5,4783%	-0,0605%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Venda	5,2785%	5,3252%	5,0223%	5,5811%	-0,0467%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Venda	5,2785%	5,3252%	5,0223%	5,5811%	-0,0467%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Venda	5,2785%	5,3252%	5,0223%	5,5811%	-0,0467%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	GUIDE CT	NTN-B	15/05/2025	Venda	5,2889%	5,3288%	5,0153%	5,5708%	-0,0399%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,2790%	5,2578%	4,9729%	5,5102%	0,0212%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Venda	5,2775%	5,2700%	5,0026%	5,4923%	0,0075%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Venda	5,2775%	5,2700%	5,0026%	5,4923%	0,0075%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2030	Compra	5,2690%	5,2700%	5,0215%	5,4734%	-0,0010%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2035	Venda	5,2703%	5,2697%	5,0657%	5,4536%	0,0006%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2045	Venda	5,3203%	5,3367%	5,1488%	5,4864%	-0,0164%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,3433%	5,3600%	5,1751%	5,5054%	-0,0167%	NÃO
17/11/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2055	Compra	5,3498%	5,3655%	5,1842%	5,5102%	-0,0157%	NÃO

FIM EMB VI A CRED PRIV												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
01/11/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2024	Venda	5,4500%	5,5761%	5,2493%	5,8086%	-0,1261%	NÃO
01/11/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,4610%	5,5100%	5,2002%	5,7057%	-0,0490%	NÃO
01/11/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,4610%	5,5100%	5,2002%	5,7057%	-0,0490%	NÃO
01/11/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,4610%	5,5100%	5,2002%	5,7057%	-0,0490%	NÃO
29/11/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,3590%	5,3402%	5,1936%	5,5233%	0,0188%	NÃO
30/11/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2055	Compra	5,3590%	5,3035%	5,1790%	5,5039%	0,0555%	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.