



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Outubro/2022





1. INTRODUÇÃO

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

Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento dos Planos administrados pela EMBRAER PREV, bem como na Resolução CMN Nº 4.994/2022.

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: 31/10/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	4.109.822.494,94	VAR / PL:	1,512%
VAR:	62.159.648,87	ETL / PL:	1,8967%
ETL:	77.950.734,16	VAR / CDI:	2978,00%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(153.705.297,26)	BAIXA 1:	269.180.334,48	Cenário 1:	314.197.542,84
				Cenário 2:	(71.797.182,86)
				Cenário 3:	649.413.979.264,62

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	108.971,57	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	27.674,99	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	12.207.005,05	985.701,25	320.631,42	0,52%	(123.857,22)	(485,33)	170.346,76
AIEC11	4.167.764,00	244.444,50	104.184,06	0,17%	40.383,40	-	(54.256,55)
ALPA4	208.328,16	29.796,23	1.419,36	0,00%	4.551,69	17,56	(6.029,71)
ALSO3	2.790.018,00	252.445,28	107.978,74	0,17%	967.489,06	3.240,14	(928.311,74)
AMER3	2.700.814,64	791.076,57	62.832,34	0,10%	368.025,93	-	(430.407,82)
ARZZ3	303.712,56	35.318,70	14.105,57	0,02%	39.948,56	146,36	(46.948,74)
ASAI3	763.686,00	81.115,17	32.388,31	0,05%	(10.834,51)	-	14.973,34
AURE3	11.478.277,44	750.582,81	(27.723,24)	-0,04%	-	-	-
AZUL4	247.504,72	55.154,12	35.234,98	0,06%	(5.338,83)	(21,04)	7.444,06
B3SA3	21.037.618,16	1.871.034,72	1.360.141,33	2,19%	6.998.115,32	23.566,23	(6.797.256,85)
UNT	17.296.289,22	1.707.469,41	920.657,50	1,48%	2.229.550,77	8.177,88	(2.627.384,50)
BBAS3	12.238.315,56	1.691.317,19	1.041.062,79	1,67%	453.556,47	1.736,41	(590.471,23)
BBDC3	1.249.141,95	83.552,24	70.090,16	0,11%	160.381,12	588,40	(189.099,11)
BBDC4	20.464.323,06	1.616.491,97	1.185.206,82	1,91%	2.192.893,59	8.123,19	(2.643.753,33)
BBSE3	1.004.503,20	104.005,53	26.868,80	0,04%	(47.211,20)	(188,51)	67.908,84
BEEF3	1.363.311,00	222.447,20	52.543,88	0,08%	(170.058,43)	(707,96)	270.584,62
BMGB4	142.500,00	19.890,95	5.551,19	0,01%	37.889,71	131,05	(39.064,92)
BMLC11	2.347.632,00	102.184,51	(28.844,20)	-0,05%	132.367,59	-	(168.623,67)
BPAN4	126.476,46	14.244,22	5.172,49	0,01%	270,59	1,05	(366,78)
BPML11	1.082.745,06	84.686,92	(21.176,34)	-0,03%	126.429,60	466,29	(150.887,40)
BRAP4	305.551,16	44.557,66	3.060,54	0,00%	97.282,44	329,44	(95.676,83)
BRFS3	678.150,85	116.084,85	31.401,95	0,05%	(125.568,04)	(541,16)	217.568,06
BRKM5	440.201,12	126.074,75	6.493,40	0,01%	86.035,92	306,48	(94.822,58)
BRML3	8.754.512,55	623.060,96	294.530,76	0,47%	2.766.082,99	9.376,22	(2.726.240,54)
BTLG11	3.914.574,48	130.817,95	31.032,60	0,05%	(54.535,28)	(214,10)	75.344,91
CASH3	39.299,13	6.616,31	4.268,17	0,01%	(4.770,87)	-	7.556,77
CCRO3	730.168,13	112.550,27	49.296,04	0,08%	(139.211,27)	(601,91)	243.163,80
CEOC11	870.470,00	34.183,59	8.919,94	0,01%	11.196,22	43,37	(14.987,00)
CIEL3	3.355.100,64	527.194,24	322.116,46	0,52%	787.502,83	2.759,04	(835.833,91)
CLSA3	165.838,00	25.423,40	16.359,40	0,03%	77.820,41	-	(67.523,94)
CMIG4	834.951,40	117.016,17	66.756,42	0,11%	(61.860,51)	(250,54)	92.070,64
CMIN3	184.705,08	18.479,02	14.096,90	0,02%	(5.790,88)	-	8.170,79
CNES11	487.790,16	46.801,27	26.239,76	0,04%	(44.221,83)	(180,69)	67.242,07
CNRD11	78.302,00	-	-	0,00%	-	-	-
COGN3	295.263,00	30.114,92	13.918,53	0,02%	80.557,62	277,84	(82.529,91)
CPFE3	4.422.429,75	399.541,06	200.884,97	0,32%	(250.357,62)	(1.004,66)	364.460,80
CPLE6	582.145,80	61.350,05	9.031,59	0,01%	(1.422,03)	(5,55)	1.937,98



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	4.109.822.494,94	VAR / PL:	1,512%
VAR:	62.159.648,87	ETL / PL:	1,8967%
ETL:	77.950.734,16	VAR / CDI:	2978,00%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(153.705.297,26)	BAIXA 1:	269.180.334,48	Cenário 1:	314.197.542,84
				Cenário 2:	(71.797.182,86)
				Cenário 3:	649.413.979.264,62

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CRFB3	508.635,34	96.160,42	28.348,40	0,05%	(95.162,23)	(410,59)	165.352,52
CSAN3	5.067.589,56	860.627,11	520.350,87	0,84%	(1.010.813,39)	(4.393,52)	1.788.851,86
CSNA3	370.297,11	61.557,53	29.411,31	0,05%	40.438,55	149,66	(48.647,19)
CVCB3	92.102,82	14.633,57	6.689,38	0,01%	(12.485,56)	(52,29)	20.162,25
CYRE3	249.840,47	25.508,87	12.000,37	0,02%	109.208,99	353,47	(97.207,70)
DXCO3	131.470,08	20.246,18	10.229,85	0,02%	(26.794,59)	-	47.728,00
ECOR3	90.381,51	14.130,37	8.685,18	0,01%	(9.709,49)	(40,04)	15.093,68
EGIE3	511.216,86	23.765,06	6.773,78	0,01%	(28.045,30)	(112,44)	40.737,75
ELET3	16.332.598,62	1.725.624,98	657.634,95	1,06%	1.674.597,79	6.216,42	(2.028.830,52)
ELET6	4.585.412,88	510.509,59	158.489,21	0,25%	654.157,07	2.384,68	(760.030,69)
EMBR3	492.046,75	89.585,37	47.208,45	0,08%	(62.422,28)	(260,17)	99.609,01
ENBR3	283.549,68	20.713,40	12.288,74	0,02%	(2.223,35)	(8,70)	3.049,50
ENEV3	9.590.270,36	1.313.597,41	339.898,17	0,55%	(2.339.238,66)	(10.448,51)	4.432.808,24
ENH11	589.387,50	43.357,72	24.255,16	0,04%	42.990,04	161,79	(53.773,54)
ENJU3	166.228,00	38.706,33	17.456,50	0,03%	(29.083,48)	-	49.649,40
EQTL3	27.531.514,12	2.926.752,25	461.854,76	0,74%	10.130.439,23	33.650,93	(9.546.077,24)
EUCATEX PN	135.261,00	18.173,64	3.722,30	0,01%	(24.900,81)	(107,25)	43.077,50
EZTC3	1.499.986,67	188.433,39	93.792,27	0,15%	372.439,49	1.297,51	(390.296,02)
FLRY3	283.866,52	24.215,15	3.178,84	0,01%	75.282,24	260,45	(77.666,45)
GALG11	2.767.330,50	87.801,49	11.227,97	0,02%	35.325,89	-	(47.291,74)
GGBR4	5.429.780,98	519.316,56	106.808,51	0,17%	1.382.094,51	4.802,55	(1.439.973,11)
GGPS3	5.195.223,90	559.099,21	278.203,87	0,45%	106.832,99	-	(141.733,47)
GMAT3	9.600.828,55	3.049.035,90	789.425,45	1,27%	(852.615,96)	(3.480,39)	1.293.332,90
GOAU4	2.212.577,22	185.254,70	39.385,46	0,06%	630.641,06	2.164,29	(638.962,69)
GOLL4	85.651,00	17.431,70	12.827,31	0,02%	(6.374,88)	(25,82)	9.492,24
GTLG11	209.698,60	3.398,67	707,56	0,00%	(585,75)	-	798,61
HAPV3	13.999.311,07	3.239.580,91	1.482.020,40	2,38%	(1.383.731,76)	(5.679,14)	2.126.745,10
HBRH11	2.511.991,50	161.216,88	(19.239,57)	-0,03%	181.871,01	-	(227.625,35)
HSML11	9.738.188,48	859.556,97	213.721,36	0,34%	365.750,60	1.399,91	(475.890,51)
HYPE3	4.977.974,35	283.755,50	75.635,55	0,12%	1.139.099,71	4.000,71	(1.215.761,89)
IGT11	4.342.706,50	341.718,74	162.658,62	0,26%	-	-	-
INTB3	2.508.783,00	277.563,10	44.127,31	0,07%	1.112.591,09	-	(985.289,43)
IRBR3	59.533,95	19.168,04	9.920,72	0,02%	(16.587,52)	(75,75)	33.257,44
ITSA4	13.478.940,80	780.764,04	484.018,82	0,78%	3.656.254,09	12.618,16	(3.751.171,30)
ITUB4	35.028.620,62	1.987.571,96	1.732.071,72	2,79%	8.340.961,12	29.181,35	(8.824.560,59)
JBSS3	5.542.167,84	557.800,69	133.194,59	0,21%	(1.096.473,20)	(4.761,21)	1.935.750,47
KLBN11	783.727,67	135.260,95	23.464,35	0,04%	190.447,49	664,94	(200.568,03)
LREN3	15.415.537,52	1.523.748,06	740.018,01	1,19%	4.344.435,68	14.928,96	(4.414.547,84)
LWSA3	3.893.668,74	903.179,42	633.539,78	1,02%	1.504.841,90	4.963,57	(1.396.137,59)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	4.109.822.494,94	VAR / PL:	1,512%
VAR:	62.159.648,87	ETL / PL:	1,8967%
ETL:	77.950.734,16	VAR / CDI:	2978,00%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(153.705.297,26)	BAIXA 1:	269.180.334,48	Cenário 1:	314.197.542,84
				Cenário 2:	(71.797.182,86)
				Cenário 3:	649.413.979.264,62

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
MALL11	61.544,00	2.388,43	1.305,77	0,00%	1.841,74	7,08	(2.417,26)
MALL13	661.468,58	-	-	0,00%	-	-	-
MALL14	2.910.574,59	-	-	0,00%	-	-	-
MATD3	1.459.265,85	189.229,87	123.496,89	0,20%	21.929,77	-	(29.280,89)
MAXR11	1.438.772,00	117.227,19	(9.135,30)	-0,01%	(84.998,11)	(341,53)	124.120,85
MGLU3	642.103,62	207.433,15	84.489,20	0,14%	95.811,84	348,26	(110.576,29)
MRFG3	177.833,52	37.858,18	13.442,63	0,02%	(40.387,75)	(178,52)	74.543,78
MRVE3	149.072,33	60.851,53	7.903,45	0,01%	(41.399,18)	(188,96)	82.878,19
MULT3	4.527.076,36	303.333,51	181.373,07	0,29%	503.400,55	1.861,32	(604.313,83)
NEWL11	146.131,81	8.044,24	1.534,40	0,00%	-	-	-
NEWU11	455.937,60	37.390,62	(5.137,89)	-0,01%	95.086,00	-	(103.472,70)
NEXP3	4.543,00	-	-	0,00%	-	-	-
NINJ3	317.772,00	73.091,63	26.441,79	0,04%	149.959,60	-	(129.848,02)
NTCO3	3.039.619,24	566.067,72	4.787,96	0,01%	(489.292,70)	(2.079,17)	818.708,11
ONCO3	1.162.500,00	116.856,19	9.062,19	0,01%	263.434,02	-	(281.755,71)
PACUCAR_CBD ON ED	169.778,32	33.469,09	7.006,95	0,01%	(23.796,23)	(99,92)	38.671,93
PATC11	10.712.048,00	428.097,21	198.332,21	0,32%	1.094.566,96	4.063,89	(1.326.597,93)
PETR3	13.443.440,50	2.312.308,74	1.273.312,17	2,05%	2.820.020,48	9.984,38	(3.065.144,96)
PETR4	23.589.995,02	4.068.432,65	2.217.441,00	3,57%	5.299.945,37	18.646,85	(5.679.021,07)
PETZ3	4.175.066,84	958.005,00	360.285,77	0,58%	(941.399,39)	(4.156,96)	1.733.169,15
POS13	43.023,97	16.063,03	6.382,00	0,01%	(370,83)	(1,45)	509,09
PRI03	17.745.172,20	1.893.041,21	29.943,50	0,05%	7.912.752,25	25.528,56	(6.993.788,18)
QAGR11	8.377.750,00	154.349,59	24.309,44	0,04%	391.936,11	-	(504.678,19)
QUAL3	106.168,87	14.855,24	11.268,35	0,02%	(24.494,54)	(108,51)	45.463,38
RADL3	5.447.635,56	321.600,87	163.944,32	0,26%	715.552,60	2.621,72	(841.097,92)
RAIL3	10.802.621,52	1.487.965,28	652.460,83	1,05%	539.372,02	2.052,21	(692.077,14)
RAIZ4	263.894,35	35.019,57	27.228,45	0,04%	(16.697,60)	-	24.512,53
RBRL11	3.231.623,45	310.322,94	91.481,99	0,15%	(184.646,65)	-	268.979,03
RCRB11	5.885.460,00	423.320,17	168.391,47	0,27%	486.672,50	1.823,28	(602.316,10)
RDOR3	2.816.347,20	549.158,14	279.718,85	0,45%	(580.320,72)	-	1.037.197,81
RECV3	4.517.598,82	686.972,24	1.083,66	0,00%	1.154.117,89	-	(1.201.411,05)
RENT3	15.252.146,10	1.119.092,63	692.109,42	1,11%	3.090.886,26	10.976,60	(3.382.751,75)
RENT9	19.767,95	122.462,77	(5.396,16)	-0,01%	-	-	-
RNGO11	130.842,20	17.781,56	3.113,11	0,01%	(14.101,50)	(58,16)	21.931,30
RRRP3	445.503,25	72.223,69	10.165,57	0,02%	199.223,31	642,45	(175.906,87)
SANB11	526.060,00	33.617,19	21.939,18	0,04%	39.876,60	149,88	(49.723,32)
SBSP3	3.473.742,22	617.279,53	9.298,61	0,01%	2.050.698,72	6.288,92	(1.624.507,54)
SLCE3	221.580,32	27.729,67	7.844,91	0,01%	(35.291,64)	(149,82)	58.909,47
SMT03	147.135,66	21.949,92	7.425,48	0,01%	(11.689,77)	(47,48)	17.518,69



Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	4.109.822.494,94	VAR / PL:	1,512%
VAR:	62.159.648,87	ETL / PL:	1,8967%
ETL:	77.950.734,16	VAR / CDI:	2978,00%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(153.705.297,26)	BAIXA 1:	269.180.334,48	Cenário 1:	314.197.542,84
				Cenário 2:	(71.797.182,86)
				Cenário 3:	649.413.979.264,62

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
SOMA3	5.178.588,18	783.236,48	501.344,76	0,81%	605.497,23	2.232,99	(722.512,72)
SPY	9.555.153,20	900.432,43	74.952,82	0,12%	(726.965,38)	(89.009,32)	1.084.750,51
STBP3	3.677.693,00	529.722,45	196.243,00	0,32%	35.773,59	138,80	(48.060,99)
SULA11	982.075,05	185.270,05	99.284,78	0,16%	(202.909,88)	(885,75)	362.963,09
SUZB3	15.913.067,61	3.455.503,78	325.897,78	0,52%	5.493.503,06	18.408,92	(5.278.080,18)
TAE11	440.680,44	36.552,94	11.773,08	0,02%	(44.913,09)	(184,64)	69.310,37
TEND3	509.760,00	239.321,04	52.881,89	0,09%	(159.103,18)	(743,00)	337.788,11
TEPP11	9.534.541,26	938.813,67	314.380,21	0,51%	256.916,01	988,42	(338.352,53)
TIMS3	3.599.206,29	305.680,53	(39.873,30)	-0,06%	383.121,02	1.419,67	(462.238,79)
TOTS3	4.567.680,00	432.198,78	308.871,96	0,50%	834.164,65	2.987,97	(931.002,83)
TRXF11	13.553.925,12	1.163.275,15	184.933,25	0,30%	(268.502,64)	(1.057,27)	373.586,28
TRXF13	3.244.035,93	-	-	0,00%	-	-	-
UGPA3	3.894.077,25	519.450,38	227.592,60	0,37%	(136.924,70)	(543,40)	194.099,30
URTH_US	3.324.292,29	122.894,27	(82.617,80)	-0,13%	8.307,75	(29.918,63)	(11.256,20)
USIM5	193.121,25	23.171,41	10.529,00	0,02%	(11.646,52)	(46,83)	17.033,50
VALE3	48.512.670,55	5.595.118,56	681.526,33	1,10%	12.023.624,65	41.895,81	(12.605.385,33)
VBBR3	7.293.387,96	709.711,05	433.880,59	0,70%	(51.533,50)	-	70.617,08
VIA3	244.504,16	60.913,93	33.619,43	0,05%	48.563,13	-	(53.357,55)
VIVT3	900.555,66	42.873,35	5.861,38	0,01%	(60.950,85)	(246,02)	89.978,64
VTV_US	6.038.153,95	552.244,33	(15.943,96)	-0,03%	(191.583,23)	(54.343,39)	270.443,38
WEGE3	9.497.281,25	1.201.308,95	156.514,74	0,25%	4.101.251,47	13.300,25	(3.666.096,40)
XPIN11	3.587.543,26	331.844,27	126.480,97	0,20%	100.358,01	-	(132.013,55)
XPPR11	3.335.524,20	278.972,27	118.067,83	0,19%	(422.208,42)	-	673.470,34
YDUQ3	1.731.898,80	368.302,18	56.912,19	0,09%	586.776,21	1.971,23	(566.897,49)
INDZ22	-	906.564,54	751.364,99	1,21%	-	-	-
WINZ22	-	210.158,14	(174.180,06)	-0,28%	-	-	-
DI1Z22	-	4.982,28	(988,94)	0,00%	44.307,25	(22.871,95)	(67.554,67)
DI1F23	-	1.471,96	(116,63)	0,00%	16.655,44	(8.586,18)	(25.337,45)
DI1J23	-	36.580,89	16.808,09	0,03%	598.217,98	(307.216,46)	(904.283,92)
DAPK23	-	223.688,57	63.021,32	0,10%	180.415,76	(65.493,85)	(393.908,87)
DI1N23	-	3.384,74	(2.046,34)	0,00%	(31.282,47)	16.013,30	47.033,46
DI1V23	-	236,40	142,82	0,00%	1.594,80	(813,63)	(2.384,42)
DI1F24	-	796.001,80	(551.391,70)	-0,89%	(4.344.891,77)	2.210.319,32	6.465.260,20
DI1J24	-	7.094,59	5.159,66	0,01%	33.347,38	(16.917,77)	(49.394,83)
DI1N24	-	11.561,83	8.762,85	0,01%	47.619,82	(24.092,15)	(70.213,87)
DAPQ24	-	573.210,69	107.554,06	0,17%	572.738,12	(206.351,66)	(1.228.598,09)
DI1V24	-	7.543,70	5.751,40	0,01%	27.806,48	(14.028,24)	(40.807,15)
DI1F25	-	125.600,06	95.426,14	0,15%	419.321,99	(210.931,07)	(612.405,80)
DAPK25	-	197.548,87	75.413,11	0,12%	-	-	-



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	4.109.822.494,94	VAR / PL:	1,512%
VAR:	62.159.648,87	ETL / PL:	1,8967%
ETL:	77.950.734,16	VAR / CDI:	2978,00%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(153.705.297,26)	BAIXA 1:	269.180.334,48	Cenário 1:	314.197.542,84
				Cenário 2:	(71.797.182,86)
				Cenário 3:	649.413.979.264,62

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DI1N25	-	205.016,82	(154.623,39)	-0,25%	(613.702,02)	306.892,08	887.560,15
DI1F26	-	71.033,55	54.006,39	0,09%	206.678,07	(102.652,28)	(295.561,06)
DAPQ26	-	193.212,78	130.660,19	0,21%	-	-	-
DI1F27	-	1.064.119,60	805.561,76	1,30%	3.018.768,61	(1.480.094,59)	(4.225.840,20)
DAPK27	-	16.209,81	12.380,45	0,02%	-	-	-
DAPQ28	-	140.891,81	(117.147,19)	-0,19%	-	-	-
DI1F29	-	148.135,99	106.941,03	0,17%	415.879,76	(198.512,56)	(557.086,28)
DAPQ30	-	0,61	(0,51)	0,00%	(2,53)	0,88	5,00
DI1F31	-	14.677,67	(10.423,42)	-0,02%	(43.100,96)	20.022,35	55.230,35
DI1F33	-	6.121,79	4.378,15	0,01%	18.736,01	(8.471,85)	(22.978,57)
DAPK35	-	8.004,78	(6.837,38)	-0,01%	-	-	-
DOLZ22	-	524.314,21	352.059,47	0,57%	(11.956,66)	116.143,01	12.245,35
WDOZ22	-	128.605,37	86.354,21	0,14%	(2.932,77)	28.487,91	3.003,58
COMPROMISSADA	693.127.634,87	6.983,14	(3.149,44)	-0,01%	54.687,38	(28.264,23)	(83.548,12)
EMP AÇÃO PROVISÃO	16.385,21	13,87	10,74	0,00%	86,36	(35,76)	(93,93)
LTN	20.686.531,69	235.698,45	180.013,95	0,29%	771.844,27	(386.890,18)	(1.120.709,16)
DE252 1V11 CDI - VECS11	4.258.020,37	53.735,49	41.200,27	0,07%	182.487,82	(86.790,08)	(243.293,30)
AEGP13	673.289,37	10,72	(3,41)	0,00%	17,96	(9,25)	(27,29)
AEGPA1	1.921.900,90	2.406,40	1.865,26	0,00%	7.847,99	(3.874,55)	(11.115,19)
ALSCA0	2.559.589,11	22.266,14	16.621,43	0,03%	61.052,36	(30.173,60)	(86.591,86)
AMBP13	2.795.471,34	2.233,21	1.125,41	0,00%	3.595,52	(2.264,54)	(7.369,68)
ANHB10	723.484,69	70,05	55,28	0,00%	326,99	(164,98)	(480,01)
APRB28	1.369.354,19	167,83	133,91	0,00%	687,38	(344,99)	(1.000,28)
BCBF14	265.283,94	32,26	24,52	0,00%	172,65	(87,57)	(255,67)
BCBF15	2.733.139,67	350,95	269,32	0,00%	1.848,10	(936,59)	(2.732,79)
BKBR18	1.431.328,99	73,66	43,60	0,00%	447,87	(228,03)	(667,39)
BRKPA0	2.390.824,22	1.717,54	1.351,16	0,00%	6.106,95	(3.051,95)	(8.823,91)
BRML17	3.182.143,07	2.524,81	(1.899,20)	0,00%	(7.854,64)	3.972,46	11.575,30
CCPRA3	2.129.244,26	3.759,86	(2.254,42)	0,00%	(4.677,47)	2.282,98	6.493,01
CEAB11	1.791.813,28	166,06	120,00	0,00%	951,75	(483,50)	(1.413,00)
CEAB22	573.855,38	331,49	262,58	0,00%	1.216,49	(607,41)	(1.755,26)
VVEO15	4.186.056,63	56.857,82	42.734,24	0,07%	187.589,64	(89.032,03)	(249.212,76)
CGBP13	2.214.640,48	1.594,48	1.248,12	0,00%	5.446,15	(2.696,44)	(7.749,92)
CPGT14	150.389,43	61,25	(38,25)	0,00%	(510,95)	263,34	776,98
CPGT16	299.278,01	103,21	(78,99)	0,00%	(518,36)	265,01	777,76
RSAN24	1.651.279,26	9.931,75	7.637,19	0,01%	29.093,49	(14.662,24)	(42.591,82)
RLOG11	1.549.146,93	171,63	129,44	0,00%	934,68	(474,37)	(1.385,43)
CSAN23	1.140.899,49	1.933,12	1.464,15	0,00%	6.013,17	(2.925,86)	(8.316,61)
DASAA2	2.773.424,13	83,08	40,71	0,00%	504,81	(257,22)	(753,21)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	4.109.822.494,94	VAR / PL:	1,512%
VAR:	62.159.648,87	ETL / PL:	1,8967%
ETL:	77.950.734,16	VAR / CDI:	2978,00%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(153.705.297,26)	BAIXA 1:	269.180.334,48	Cenário 1:	314.197.542,84
				Cenário 2:	(71.797.182,86)
				Cenário 3:	649.413.979.264,62

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
ERDV18	1.827.583,18	16.977,33	12.407,01	0,02%	47.527,22	(22.910,85)	(64.702,32)
ERDVA0	2.147.717,58	39,81	(10,86)	0,00%	135,88	(70,01)	(206,53)
ELEK27	582.798,16	47,59	(32,29)	0,00%	(683,82)	353,32	1.044,20
ELET13	2.048.920,62	628,43	495,92	0,00%	2.546,62	(1.282,54)	(3.726,78)
ETEN13	7.805.662,15	64.355,56	50.005,87	0,08%	233.389,89	(112.946,48)	(320.013,33)
EQTL13	1.442.741,71	68,29	39,14	0,00%	417,20	(212,50)	(622,08)
GGSH12	2.412.658,93	538,37	422,25	0,00%	2.605,41	(1.317,86)	(3.840,43)
GUAR15	2.804.419,19	1.195,31	949,24	0,00%	4.712,14	(2.365,64)	(6.860,11)
GRRB14	1.094.230,04	123,51	97,39	0,00%	534,31	(269,35)	(783,17)
IGTA37	2.116.791,21	1.461,56	(1.115,85)	0,00%	(5.386,66)	2.739,09	8.009,92
IVIA35	1.373.691,71	79,31	54,84	0,00%	460,00	(233,70)	(682,98)
DE252 LIGHT CDI - LIGHB4	2.064.511,37	68,14	23,66	0,00%	478,24	(244,42)	(717,16)
DE252 LIGHT CDI - LIGHD3	1.630.467,84	1.468,81	1.145,22	0,00%	4.885,44	(2.421,06)	(6.962,09)
LCAMA9	1.980.442,99	438,35	343,00	0,00%	2.044,97	(1.034,49)	(3.014,85)
MOVI27	1.186.214,02	1.752,02	1.357,00	0,00%	5.701,44	(2.814,03)	(8.071,40)
MOVI33	1.599.379,31	22,58	(8,15)	0,00%	-	-	-
MULP16	3.289.519,10	1.253,27	(929,98)	0,00%	(5.526,18)	2.821,70	8.274,13
NTSD35	1.869.713,34	3.517,92	2.644,17	0,00%	10.853,17	(5.249,70)	(14.866,56)
OMGE13	5.021.591,72	3.748,61	2.929,15	0,00%	12.648,65	(6.263,18)	(18.002,09)
OUSA10	1.587.630,36	496,34	392,14	0,00%	2.105,57	(1.061,89)	(3.088,47)
PRLG14	3.058.906,18	7.289,92	(5.034,27)	-0,01%	(40.547,90)	20.660,73	60.498,62
RDCO10	3.369.156,92	22.817,99	17.759,24	0,03%	64.524,13	(32.567,33)	(94.628,13)
LRENB1	1.402.442,16	75,88	49,80	0,00%	461,56	(234,90)	(687,30)
CBAN22	3.302.857,32	1.103,63	877,48	0,00%	4.368,62	(2.193,47)	(6.361,43)
RDORB9	1.129.091,66	1.835,50	1.390,12	0,00%	5.710,07	(2.778,12)	(7.896,21)
SNGO18	2.566.069,70	281,56	214,14	0,00%	1.511,02	(766,31)	(2.237,00)
SBFC11	3.426.680,04	19.082,08	14.241,83	0,02%	59.951,06	(30.654,94)	(89.856,75)
UGEL11	862.418,33	318,63	253,08	0,00%	1.270,52	(638,23)	(1.851,54)
VAMO22	1.098.481,18	241,65	191,64	0,00%	1.069,73	(539,70)	(1.570,11)
VCCS11	1.918.207,56	2.490,69	1.914,31	0,00%	7.915,77	(3.888,72)	(11.120,32)
VIXL14	2.082.159,70	405,48	318,87	0,00%	1.954,18	(988,52)	(2.880,80)
LF cdi	2.132.803,88	30,11	(10,87)	0,00%	-	-	-
LF selic	9.653.431,03	3.536,31	(2.684,38)	0,00%	(14.545,91)	7.555,53	22.408,43
LF002100BMM	1.155.288,83	16,31	(5,89)	0,00%	-	-	-
LF002100BMX	1.155.288,83	16,31	(5,89)	0,00%	-	-	-
LF0021006S0	1.124.314,33	15,87	(5,73)	0,00%	-	(0,00)	-
LF00220018H	1.130.171,16	15,95	(5,76)	0,00%	(0,00)	(0,00)	0,00
LF0021003Q1	2.151.284,21	30,37	(10,97)	0,00%	-	-	(0,00)
LF002100HDP	1.338.987,81	18,90	(6,83)	0,00%	0,00	0,00	0,00



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	4.109.822.494,94	VAR / PL:	1,512%
VAR:	62.159.648,87	ETL / PL:	1,8967%
ETL:	77.950.734,16	VAR / CDI:	2978,00%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(153.705.297,26)	BAIXA 1:	269.180.334,48	Cenário 1:	314.197.542,84
				Cenário 2:	(71.797.182,86)
				Cenário 3:	649.413.979.264,62

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
LF002100HDQ	2.439.286,77	34,44	(12,44)	0,00%	-	-	-
LF002100E1F	1.153.194,03	16,28	(5,88)	0,00%	-	-	-
LFSC22002IX	4.691.683,90	3.938,82	3.110,81	0,01%	13.750,07	(6.860,30)	(19.813,43)
LFSN210029N	3.796.691,86	53,60	(19,36)	0,00%	-	-	0,00
LFT	72.679.386,90	7.274,04	(1.879,35)	0,00%	-	-	-
LF002100ISJ	2.500.761,32	35,30	(12,75)	0,00%	-	-	(0,00)
17H0164854	6.642.794,01	83.008,81	32.873,30	0,05%	141.926,54	(50.345,96)	(290.343,29)
AEGP23	10.905.748,11	170.105,95	44.627,39	0,07%	211.469,18	(76.154,81)	(444.206,03)
CCRDD1	4.631.213,25	65.722,29	13.532,80	0,02%	65.493,51	(23.495,66)	(139.372,96)
GMDT33	1.995.307,15	23.904,65	6.300,63	0,01%	24.112,15	(8.691,03)	(51.776,20)
GASP17	36.209.169,30	580.793,90	190.564,08	0,31%	1.254.713,25	(20.975,31)	(2.525.700,12)
CSMGC3	12.000.329,01	148.785,85	39.582,02	0,06%	158.325,48	(56.933,16)	(334.861,64)
GEP24	7.274.733,61	63.788,53	15.795,98	0,03%	54.585,48	(19.784,82)	(118.748,57)
ERDV17	12.269.132,61	187.882,57	48.392,36	0,08%	228.389,58	(82.386,86)	(479.936,37)
ERDV36	3.087.475,50	43.814,86	9.021,87	0,01%	43.662,34	(15.663,77)	(92.915,31)
ECPT11	1.071.936,99	7.107,95	3.083,51	0,00%	2.706,78	(983,48)	(5.922,27)
DE252 IRB IPCA - IRBR12	9.252.502,49	125.718,45	61.749,16	0,10%	263.595,90	(93.775,95)	(536.129,42)
LIGHD7	4.489.415,35	65.932,22	29.694,28	0,05%	127.701,97	(45.017,24)	(264.119,17)
LORTA7	5.097.004,94	74.935,59	54.646,15	0,09%	273.448,41	(91.352,30)	(520.596,21)
LCAMD1	8.414.892,46	118.861,30	89.604,41	0,14%	444.672,74	(152.481,73)	(836.706,56)
MOV137	1.107.909,46	15.299,57	12.025,63	0,02%	58.998,31	(20.689,66)	(109.412,43)
MVLV16	6.422.325,05	93.122,50	68.501,95	0,11%	341.270,23	(120.118,51)	(693.382,27)
PETR45	13.075.329,80	171.243,49	35.604,33	0,06%	164.187,26	(59.129,43)	(352.153,90)
RDCO34	3.131.399,77	19.371,81	5.411,69	0,01%	15.163,68	(5.506,19)	(33.129,19)
SBESC7	5.368.011,88	35.594,98	15.441,50	0,02%	13.554,93	(4.925,03)	(29.657,36)
SBSPC2	13.150.959,66	191.048,43	44.745,08	0,07%	204.849,46	(73.583,11)	(435.438,88)
JSMLB5	2.716.707,69	37.308,39	29.641,45	0,05%	144.973,90	(51.145,59)	(267.787,41)
TAE33	7.748.749,33	114.388,71	22.663,71	0,04%	111.479,81	(40.203,98)	(239.685,30)
VAMO33	6.565.502,51	91.580,70	67.842,40	0,11%	334.639,76	(114.595,93)	(633.682,95)
VAMO34	6.013.883,85	83.435,46	66.028,73	0,11%	323.651,11	(113.555,11)	(598.936,70)
TCI11	9.437.128,85	150.761,63	110.897,84	0,18%	579.208,99	(190.114,45)	(1.033.773,54)
ANEM11	11.930.492,36	162.160,97	125.995,87	0,20%	632.030,03	(215.679,48)	(1.117.795,99)
DEBIANET IPCA - ANET11	3.554.676,73	45.771,66	20.301,60	0,03%	94.013,94	(32.818,36)	(190.867,37)
DEBI B2W IPCA - BTOW15	6.579.062,75	92.824,58	72.223,54	0,12%	352.745,62	(121.941,94)	(657.347,99)
BRST11	5.611.005,47	78.178,70	37.575,60	0,06%	169.864,70	(59.579,18)	(345.242,23)
BRKP28	3.792.203,78	59.202,00	41.298,82	0,07%	217.538,99	(68.797,60)	(416.703,14)
CAEC21	9.173.003,01	210.548,52	38.723,34	0,06%	206.130,44	(41.902,61)	(529.038,95)
DEBICART IPCA - CART13	6.536.735,64	92.212,61	69.818,04	0,11%	345.817,36	(118.460,55)	(638.312,59)
GASP19	3.061.831,54	44.792,37	31.646,20	0,05%	158.680,31	(52.689,74)	(305.123,96)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	4.109.822.494,94	VAR / PL:	1,512%
VAR:	62.159.648,87	ETL / PL:	1,8967%
ETL:	77.950.734,16	VAR / CDI:	2978,00%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(153.705.297,26)	BAIXA 1:	269.180.334,48	Cenário 1:	314.197.542,84
				Cenário 2:	(71.797.182,86)
				Cenário 3:	649.413.979.264,62

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
RSAN44	5.246.271,27	74.477,77	41.665,11	0,07%	199.604,06	(67.514,94)	(397.643,31)
CTEE29	5.142.463,58	80.026,42	57.937,76	0,09%	306.572,35	(96.949,78)	(547.810,85)
MGSP12	4.477.993,06	69.896,65	45.863,32	0,07%	239.815,42	(75.269,56)	(450.619,43)
ELET42	10.935.829,92	145.992,71	90.620,34	0,15%	434.254,15	(148.193,99)	(863.918,40)
ENGA5	5.382.222,88	77.119,94	57.396,34	0,09%	286.107,28	(97.119,63)	(540.826,42)
ENMI21	910.843,96	12.298,89	4.771,87	0,01%	20.929,02	(7.448,77)	(42.973,29)
DEBI ENGIE IPCA - EGIEAO	6.879.679,71	123.895,70	96.169,30	0,15%	524.176,03	(164.420,27)	(891.123,52)
ENTV12	24.585.689,63	308.422,25	217.648,50	0,35%	1.025.169,95	(362.798,39)	(1.962.260,14)
GBSP11	9.393.409,73	160.568,40	136.179,52	0,22%	709.903,94	(237.021,91)	(1.182.756,42)
HZTC14	2.185.981,61	30.318,64	22.547,92	0,04%	111.811,09	(38.254,55)	(206.640,07)
HBSA21	4.028.098,06	57.777,44	42.919,04	0,07%	214.047,92	(72.587,27)	(404.862,89)
HARG11	11.651.722,17	173.016,26	132.068,70	0,21%	671.461,60	(226.719,09)	(1.212.480,42)
IGSN15	2.067.085,28	28.967,35	20.123,62	0,03%	99.478,68	(33.685,08)	(187.457,15)
IPIL11	4.087.409,16	52.120,68	33.439,44	0,05%	163.102,50	(56.652,07)	(303.889,47)
ENJG21	1.477.209,04	19.810,08	7.456,01	0,01%	32.619,73	(11.615,52)	(67.089,88)
LAMEA6	6.552.900,57	91.705,37	72.179,57	0,12%	352.488,53	(123.073,88)	(655.090,64)
MTRJ19	10.747.754,95	135.143,36	83.942,58	0,14%	400.283,62	(140.288,64)	(770.911,82)
CRMG15	4.137.862,14	54.409,34	31.928,29	0,05%	151.155,47	(52.099,29)	(296.055,89)
NEOE16	5.430.397,20	76.816,18	46.223,06	0,07%	224.900,43	(75.352,83)	(453.537,83)
NTEN11	8.308.187,47	106.685,36	64.262,94	0,10%	303.250,03	(107.174,80)	(591.977,91)
UTPS11	3.188.944,92	42.062,64	19.289,98	0,03%	88.577,59	(31.216,07)	(179.258,67)
UTPS21	3.299.902,76	50.531,50	42.040,49	0,07%	212.444,65	(73.098,55)	(376.578,60)
UTPS22	2.443.829,15	36.007,33	26.813,87	0,04%	135.212,89	(45.270,60)	(254.546,13)
PASN12	8.025.387,40	101.686,47	52.438,35	0,08%	240.371,24	(83.781,96)	(478.486,78)
PEJA11	10.462.617,92	141.557,46	107.078,45	0,17%	521.567,10	(182.461,02)	(977.074,23)
QUAT12	4.036.429,83	56.321,70	22.802,19	0,04%	98.117,97	(35.271,25)	(201.557,67)
CBAN32	3.752.001,57	56.133,25	40.270,73	0,06%	204.856,25	(67.356,00)	(387.780,94)
CBAN72	4.620.046,05	69.119,96	49.587,57	0,08%	252.250,78	(82.939,15)	(477.496,02)
LTTE15	7.573.461,14	117.283,03	79.406,10	0,13%	413.191,37	(133.988,25)	(771.856,01)
DEBI TESC IPCA - CJEN13	10.931.942,21	151.261,17	120.256,65	0,19%	588.718,19	(207.021,67)	(1.062.918,20)
CONX12	9.302.741,46	118.599,90	77.884,82	0,13%	365.264,01	(129.902,75)	(710.022,94)
TNHL11	5.417.345,30	86.400,31	63.401,49	0,10%	326.968,67	(109.262,01)	(582.060,21)
UHSM12	8.858.685,46	137.950,62	76.333,88	0,12%	505.745,66	(148.215,51)	(965.310,68)
UNEG11	4.504.359,67	69.698,41	54.376,38	0,09%	281.201,93	(91.360,20)	(498.436,35)
VSJH11	1.146.760,96	13.545,89	7.142,44	0,01%	31.862,24	(11.556,13)	(62.886,03)
VIMT13	6.111.277,52	87.169,06	63.270,42	0,10%	317.413,57	(106.564,22)	(586.474,54)
VRDN12	3.860.495,34	55.829,42	39.027,14	0,06%	195.573,34	(65.116,79)	(369.690,42)
LFS012001GU	890.334,57	2.533,80	440,84	0,00%	213,18	(77,38)	(465,37)
LFS012001GZ	4.451.672,86	12.669,01	2.204,20	0,00%	1.065,90	(386,90)	(2.326,86)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	4.109.822.494,94	VAR / PL:	1,512%
VAR:	62.159.648,87	ETL / PL:	1,8967%
ETL:	77.950.734,16	VAR / CDI:	2978,00%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(153.705.297,26)	BAIXA 1:	269.180.334,48	Cenário 1:	314.197.542,84
				Cenário 2:	(71.797.182,86)
				Cenário 3:	649.413.979.264,62

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
LFS012001H2	10.684.014,87	30.405,63	5.290,08	0,01%	2.558,17	(928,55)	(5.584,47)
LFS012001H4	8.013.011,15	22.804,22	3.967,56	0,01%	1.918,63	(696,41)	(4.188,36)
LFS012001H6	6.232.342,01	17.736,62	3.085,88	0,00%	1.492,27	(541,66)	(3.257,61)
LFS012001IP	8.922.444,79	39.380,93	10.031,92	0,02%	4.421,99	(1.606,57)	(9.673,88)
LFSN16000GM	13.015.906,17	233.442,34	54.161,69	0,09%	272.645,52	(98.022,75)	(581.956,97)
D - LFSN1800DC5	4.204.861,02	69.088,62	24.317,73	0,04%	106.203,58	(38.077,71)	(225.235,24)
NTNB	1.702.847.762,49	32.790.245,58	28.707.707,75	46,18%	201.775.995,30	(64.615.325,43)	(333.285.445,57)
IDIJRDG	205.015,23	210.881,56	137.118,60	0,22%	(206.775,58)	(206.775,58)	19.909.895,12
IDIJRDH	619.629,04	292.087,14	189.895,82	0,31%	(622.062,89)	(622.062,87)	19.606.692,88
IDIJRDN	(740.987,60)	567.588,15	(369.041,49)	-0,59%	745.720,06	745.720,06	(39.604.008,88)
AB AMERICAN GROWTH	4.659.857,98	447.634,69	17.458,38	0,03%	(327.358,35)	(41.938,72)	484.844,79
BB TOP RF IND PREÇO	217.509.842,52	1.883.886,03	1.493.542,74	2,40%	-	-	-
BR ELETRO FIDC S1	13.719,33	80.894,26	7.137,05	0,01%	(13.719,29)	-	649.870.979.430,00
FARM SYN AGRO FIDC	1.071.798,43	20.157,23	1.460,04	0,00%	32.793,22	-	(43.007,86)
FIDC CELG DIST SN B	1.623.768,41	42.683,01	(557,76)	0,00%	(374.784,19)	(1.660,40)	695.729,07
FIDC CREDZ SN3	211.780,16	-	-	0,00%	-	-	-
FIDC VERDECARD SN4	5.805.712,78	3.651,31	671,78	0,00%	(260.320,33)	-	373.444,41
FII HSI LOGISTICA	2.813.366,85	157.299,84	64.379,83	0,10%	150.421,85	-	(192.246,95)
FII VIA PQ SHOPPING	1.258.932,50	24.578,80	(5.556,22)	-0,01%	50.269,68	192,19	(65.232,06)
FUNDSMITH EQ FUND	5.456.637,80	469.944,73	20.353,03	0,03%	(557.847,09)	(49.109,74)	861.234,52
LOOMIS US GROWTH	5.028.681,31	185.903,06	(124.976,55)	-0,20%	12.567,19	(45.258,13)	(17.027,34)
MFS MERIDIAN EUROPEA	1.686.801,47	179.525,65	(6.820,92)	-0,01%	(100.904,08)	(15.181,21)	147.485,84
RB CAP CREDIT AL SN4	826.824,65	2.250,70	(1.104,53)	0,00%	(5.355,68)	-	7.333,83
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	266.281,79	36.573,21	6.016,27	0,01%	(160.148,81)	-	663.132,84
WELLINGTON GLO QUAL	7.379.894,95	272.824,02	(183.410,67)	-0,30%	18.443,11	(66.419,05)	(24.988,66)
Total	4.082.041.858,72	124.008.066,15	62.159.648,87	100,00%	314.197.542,84	(71.797.182,86)	649.413.979.264,62



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

EMBRAERPREV RENDA FIXA CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	2.425.814.324,05	VAR / PL:	1,374%
VAR:	33.330.529,95	ETL / PL:	1,7230%
ETL:	41.797.843,56	VAR / CDI:	2705,35%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(148.589.962,60)	BAIXA 1:	233.144.881,23	Cenário 1:	200.866.327,35
				Cenário 2:	(64.081.253,69)
				Cenário 3:	(333.609.416,18)

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	6.000,01	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(90.872,94)	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	364.489.278,14	3.636,28	(1.126,79)	0,00%	28.756,45	(14.862,29)	(43.932,45)
CRI RB CAPIT IPCA M D - 17H0164854	6.663.122,98	85.462,58	29.803,23	0,09%	139.079,82	(49.436,16)	(284.401,60)
DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23	10.940.129,59	174.544,07	38.763,07	0,12%	206.313,94	(74.402,98)	(433.463,91)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.640.775,34	67.194,35	11.538,07	0,03%	63.940,36	(22.962,79)	(136.090,89)
DE252 CEMIG - IPCA CMDT33	1.998.867,11	24.470,62	5.065,96	0,02%	23.536,25	(8.487,62)	(50.597,17)
DE252 COMGAS IGP100 - GASP17	36.169.173,11	589.828,12	128.010,17	0,38%	1.263.472,85	(25.015,39)	(2.536.968,34)
DE252 CSMG IPCA - CSMGC3	12.024.907,99	152.221,04	32.484,78	0,10%	154.647,93	(55.690,88)	(327.123,05)
DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24	7.282.438,00	66.187,69	10.875,20	0,03%	53.156,58	(19.273,32)	(115.729,62)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	9.544.478,90	149.524,97	32.251,69	0,10%	172.786,32	(62.412,83)	(363.150,53)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36	3.093.850,22	44.796,24	7.692,05	0,02%	42.626,91	(15.308,53)	(90.727,26)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	1.072.214,08	7.002,18	2.212,21	0,01%	2.704,81	(982,77)	(5.918,07)
DE252 PETR IPCA - PETR45	13.101.233,48	176.084,08	28.462,99	0,09%	160.078,52	(57.698,42)	(343.541,51)
DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34	3.133.971,60	20.022,77	2.989,94	0,01%	14.823,57	(5.383,96)	(32.403,83)
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	5.369.407,63	35.065,34	11.078,27	0,03%	13.545,10	(4.921,50)	(29.636,39)
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	13.182.053,78	195.346,71	37.781,33	0,11%	199.950,91	(71.909,53)	(425.204,41)
DE252 TRANS AL - IPCA TAEE33	7.765.098,79	117.068,04	19.248,75	0,06%	108.801,50	(39.256,63)	(234.183,69)
DEBI ELETROB IPCA - ELET42	10.982.449,47	150.701,20	89.166,51	0,27%	428.221,62	(146.378,45)	(851.752,73)
DEBI ENERGMIR IPCA - ENMI21	913.958,80	12.674,68	4.364,51	0,01%	20.494,12	(7.307,49)	(42.071,64)
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	24.694.921,80	315.816,62	218.935,67	0,66%	1.013.028,15	(359.265,57)	(1.938.794,68)
DEBI IGUA SAN IPCA - IGSN15	2.076.072,31	29.261,49	20.209,03	0,06%	98.519,71	(33.399,56)	(185.595,97)
DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21	1.482.079,70	20.411,40	6.805,43	0,02%	31.937,01	(11.393,11)	(65.673,01)
DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16	5.455.821,50	79.450,15	45.476,51	0,14%	221.669,45	(74.371,30)	(447.023,77)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GU	890.569,09	2.514,97	574,48	0,00%	212,84	(77,26)	(464,64)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GZ	4.452.845,47	12.574,83	2.872,42	0,01%	1.064,20	(386,28)	(2.323,20)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H2	10.686.829,13	30.179,58	6.893,80	0,02%	2.554,07	(927,07)	(5.575,68)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H4	8.015.121,85	22.634,69	5.170,35	0,02%	1.915,55	(695,31)	(4.181,76)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H6	6.233.983,66	17.604,76	4.021,39	0,01%	1.489,87	(540,79)	(3.252,48)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001IP	8.925.843,87	39.641,02	12.888,33	0,04%	4.412,87	(1.603,29)	(9.654,34)
LFSN BRADESCO IPCA - LFSN16000GM	13.063.661,78	239.540,46	47.828,30	0,14%	265.561,55	(95.532,88)	(567.622,42)
LFSN BRADESCO IPCA M D - LFSN1800DC5	4.222.417,04	70.938,75	21.907,90	0,07%	103.621,43	(37.176,06)	(220.090,50)
NTNB	1.614.183.686,89	31.185.721,82	31.090.515,58	93,28%	196.023.403,09	(62.784.193,67)	(323.812.266,64)
BB TOP RF IND PREÇO	217.510.180,10	1.856.274,87	1.355.768,79	4,07%	-	-	-
Total	2.434.176.570,26	35.994.396,35	33.330.529,95	100,00%	200.866.327,35	(64.081.253,69)	(333.609.416,18)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	606.112.793,73	VAR / PL:	5,524%
VAR:	33.482.770,20	ETL / PL:	6,9275%
ETL:	41.988.759,04	VAR / CDI:	10876,93%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	1.398.924,78	BAIXA 1:	(502.963,71)	Cenário 1:	115.340.190,07
				Cenário 2:	487.471,41
				Cenário 3:	(115.768.174,23)

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	34.412,88	6,87	2,24	0,00%	953,00	3,67	(1.254,01)
CONTAS A PAGAR / RECEBER	893.395,46	178,36	58,26	0,00%	24.740,98	95,15	(32.555,40)
ABEV3	12.385.040,00	954.719,27	413.727,82	1,24%	312.634,81	1.200,60	(409.954,44)
ALPA4	227.154,24	32.086,58	4.126,44	0,01%	13.326,54	51,21	(17.501,04)
ALSO3	2.916.166,00	256.438,42	84.586,88	0,25%	1.085.018,78	3.677,00	(1.071.845,57)
AMER3	2.768.513,16	787.428,89	8.871,42	0,03%	376.957,00	294,86	(462.411,25)
ARZZ3	321.755,50	36.693,79	12.912,90	0,04%	53.805,22	198,16	(64.053,36)
ASAI3	804.692,00	85.005,00	41.682,70	0,12%	28.733,32	85,70	(38.004,24)
AURE3	11.673.885,44	831.521,00	281.596,14	0,84%	323.287,19	1.243,32	(425.397,28)
AZUL4	269.564,56	59.258,88	37.087,52	0,11%	6.244,11	23,94	(8.154,83)
B3SA3	22.313.524,48	2.104.900,27	1.412.291,77	4,22%	8.318.922,02	28.183,70	(8.212.701,51)
Banco BTG Pactual SA UNT	18.255.091,54	1.942.363,22	1.510.954,88	4,51%	3.274.799,16	11.998,90	(3.853.157,49)
BBAS3	11.670.851,16	1.628.122,75	997.932,29	2,98%	528.324,28	2.035,77	(698.359,03)
BBDC3	1.280.697,60	83.899,36	55.347,47	0,17%	188.901,55	701,51	(229.203,74)
BBDC4	21.025.424,52	1.650.271,14	813.448,91	2,43%	2.624.750,02	9.840,20	(3.254.966,27)
BBSE3	1.017.179,40	106.616,02	53.144,35	0,16%	5.664,56	19,62	(5.666,65)
BEEF3	1.381.488,48	222.214,07	102.262,15	0,31%	(116.357,62)	(491,99)	191.456,97
BMGB4	141.930,00	19.334,50	7.761,30	0,02%	39.531,35	139,01	(42.391,56)
BOVA11	12.846.499,84	730.778,32	706.425,67	2,11%	1.986.521,97	7.355,04	(2.393.793,51)
BOVV11	13.038.696,00	773.343,81	761.734,58	2,28%	2.177.489,76	8.020,14	(2.592.784,69)
BPAN4	134.664,33	15.649,00	10.225,96	0,03%	6.926,12	26,66	(9.132,87)
BRAP4	307.472,06	42.676,75	2.187,62	0,01%	99.710,43	344,27	(102.646,06)
BRFS3	689.682,16	112.654,66	58.487,23	0,17%	(109.282,93)	(480,16)	197.633,83
BRKM5	456.028,88	135.969,55	35.129,94	0,10%	113.549,99	404,14	(125.104,43)
BRML3	9.021.147,45	623.530,50	228.275,22	0,68%	3.072.283,32	10.539,82	(3.118.132,16)
CASH3	40.306,80	6.960,81	5.100,06	0,02%	(2.766,87)	4,29	4.479,77
CCRO3	737.566,56	111.839,74	63.395,82	0,19%	(105.050,07)	(457,47)	185.837,44
CIEL3	3.539.512,20	542.644,31	401.216,29	1,20%	914.182,46	3.241,36	(998.620,90)
CLSA3	181.367,00	27.008,36	18.710,41	0,06%	85.303,41	19,32	(77.751,67)
CMIG4	836.422,68	116.288,99	91.048,96	0,27%	(24.872,93)	(103,76)	39.521,81
CMIN3	186.971,40	18.489,41	15.643,14	0,05%	(7.12,47)	19,91	1.499,36
COGN3	305.476,50	31.255,99	12.274,59	0,04%	96.964,32	335,70	(100.424,55)
CPFE3	4.536.416,50	406.637,43	236.928,14	0,71%	(65.481,16)	(278,01)	107.932,14
CPLE6	590.120,40	69.333,89	35.472,79	0,11%	30.034,08	115,62	(39.613,51)
CRFB3	524.816,74	96.708,81	23.865,93	0,07%	(75.136,96)	(327,33)	133.053,23
CSAN3	5.228.859,24	867.778,59	631.772,81	1,89%	(853.882,12)	(3.762,04)	1.554.761,49
CSNA3	369.394,68	59.619,03	38.415,97	0,11%	42.800,76	161,06	(53.533,07)
CVCB3	100.975,11	17.663,83	11.868,94	0,04%	(7.607,22)	(32,04)	12.398,98
CYRE3	260.046,60	26.106,11	3.552,69	0,01%	116.553,19	383,81	(108.125,65)
DXCO3	135.815,04	21.013,76	12.941,69	0,04%	(20.611,30)	14,46	36.929,85
ECOR3	92.594,24	15.103,43	12.718,81	0,04%	(5.592,36)	(23,42)	8.987,05
EGIE3	523.583,96	27.303,80	17.106,28	0,05%	(7.383,94)	(31,38)	12.196,06
ELET3	16.804.834,02	1.986.614,38	1.358.027,34	4,06%	2.529.228,00	9.380,70	(3.059.941,45)
ELET6	4.782.750,68	588.714,24	363.910,10	1,09%	917.218,46	3.343,22	(1.066.474,18)
EMBR3	515.281,25	95.523,98	70.048,06	0,21%	(35.771,87)	(150,31)	57.960,69
ENBR3	289.574,64	21.273,81	14.527,46	0,04%	9.458,32	36,44	(12.496,28)
ENEV3	9.969.943,82	1.314.850,50	433.634,30	1,30%	(1.984.416,20)	(8.927,67)	3.806.499,81



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	606.112.793,73	VAR / PL:	5,524%
VAR:	33.482.770,20	ETL / PL:	6,9275%
ETL:	41.988.759,04	VAR / CDI:	10876,93%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	1.398.924,78	BAIXA 1:	(502.963,71)	Cenário 1:	115.340.190,07
				Cenário 2:	487.471,41
				Cenário 3:	(115.768.174,23)

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	614.610,75	53.166,29	39.635,39	0,12%	77.285,25	289,63	(95.758,42)
ENJU3	176.259,00	40.330,15	18.301,07	0,05%	(24.302,32)	18,77	42.729,38
EQTL3	28.928.319,42	3.074.344,32	630.996,07	1,88%	11.522.041,38	38.657,31	(11.134.088,82)
EUCATEX PN	135.774,00	17.958,79	6.635,80	0,02%	(18.970,83)	(82,49)	33.437,98
EZTC3	1.514.528,47	189.511,44	41.890,75	0,13%	396.099,90	1.402,56	(431.394,35)
FLRY3	287.890,80	23.857,90	356,13	0,00%	82.148,30	288,08	(87.550,26)
GGBR4	5.459.463,50	506.794,43	179.633,29	0,54%	1.495.139,14	5.267,64	(1.610.125,36)
GGPS3	5.338.140,84	569.251,63	339.787,26	1,01%	290.183,86	568,53	(382.058,71)
GMAT3	10.261.500,50	3.164.264,81	880.217,94	2,63%	(253.908,68)	(1.061,68)	405.307,87
GOAU4	2.236.432,50	181.112,80	59.357,94	0,18%	684.482,45	2.380,47	(716.078,48)
GOLL4	93.217,00	19.022,21	14.697,17	0,04%	(2.749,45)	(11,47)	4.369,34
HAPV3	15.187.013,40	3.427.940,81	1.335.103,01	3,99%	(795.385,08)	(3.322,90)	1.270.315,83
HYPE3	5.179.825,45	343.829,99	173.616,59	0,52%	1.395.084,78	4.924,20	(1.508.592,27)
IGTH1	4.554.647,20	359.977,40	216.376,91	0,65%	126.132,74	485,09	(165.971,69)
INTB3	2.618.484,00	311.177,67	112.367,54	0,34%	1.279.505,62	278,88	(1.149.576,95)
IRBR3	60.174,10	19.168,65	14.020,60	0,04%	(15.897,68)	(74,51)	33.817,80
ITSA4	13.919.598,48	815.714,56	556.437,15	1,66%	4.151.788,25	14.484,07	(4.373.722,51)
ITUB4	36.048.411,20	1.995.317,83	1.514.212,43	4,52%	9.514.694,48	33.657,66	(10.339.645,39)
JBSS3	5.363.804,16	538.775,48	317.416,19	0,95%	(871.870,68)	(3.839,64)	1.585.826,83
KLBN11	774.060,86	139.831,36	57.618,47	0,17%	221.641,52	776,95	(236.005,34)
LREN3	16.493.771,10	1.659.669,13	989.473,40	2,96%	5.129.936,33	17.805,47	(5.343.141,69)
LWSA3	4.197.021,63	971.199,84	850.900,70	2,54%	1.806.036,27	5.986,86	(1.699.848,89)
MATD3	1.559.262,00	202.018,48	146.881,38	0,44%	85.067,22	166,07	(111.988,14)
MGLU3	655.297,53	206.333,31	81.359,27	0,24%	114.304,43	419,69	(135.134,39)
MRFG3	172.826,40	36.768,36	24.802,55	0,07%	(31.370,28)	(139,67)	58.632,06
MRVE3	155.010,86	62.610,56	(1.735,11)	-0,01%	(37.256,87)	(171,95)	76.212,00
MULT3	4.847.024,08	349.125,95	283.029,09	0,85%	719.576,98	2.671,16	(872.291,19)
NEXP3	4.543,00	0,91	0,30	0,00%	125,81	0,48	(165,55)
NINJ3	316.680,00	71.392,58	36.332,62	0,11%	147.976,07	33,73	(135.203,46)
NTCO3	3.213.741,70	590.829,84	164.812,99	0,49%	(339.405,68)	(1.449,75)	572.554,92
ONCO3	1.185.000,00	125.895,91	49.623,51	0,15%	341.896,38	126,21	(363.337,60)
PACUCAR_CBD ON ED	177.590,70	34.721,12	9.663,51	0,03%	(13.942,53)	(58,80)	22.800,17
PETR3	12.496.613,50	2.138.866,85	1.405.078,00	4,20%	2.586.709,26	9.368,46	(2.964.363,36)
PETR4	21.590.965,66	3.701.913,57	2.450.858,25	7,32%	4.738.785,94	17.073,52	(5.366.896,96)
PETZ3	4.364.389,68	976.230,83	224.150,19	0,67%	(863.023,51)	(3.879,63)	1.652.224,48
POSI3	45.874,73	17.214,56	4.276,02	0,01%	907,67	3,47	(1.174,10)
PRI03	18.459.777,90	2.137.349,51	688.667,14	2,06%	9.198.185,24	29.742,45	(8.202.393,14)
QUAL3	111.399,56	15.823,06	11.239,95	0,03%	(21.903,31)	(98,40)	41.862,50
RADL3	5.770.019,79	439.477,80	323.619,28	0,97%	1.085.245,92	3.961,82	(1.266.309,50)
RAIL3	11.260.359,72	1.647.472,55	1.137.595,51	3,40%	1.240.512,24	4.678,83	(1.559.949,51)
RAIZ4	272.796,81	36.125,35	31.670,06	0,09%	(8.663,84)	29,05	13.753,91
RDOR3	2.980.325,31	579.885,45	341.650,56	1,02%	(444.970,56)	317,42	794.575,67
RECV3	4.568.587,52	742.342,35	210.738,99	0,63%	1.423.453,19	486,57	(1.481.889,14)
RENT3	16.055.609,40	1.333.640,44	1.186.253,68	3,54%	3.976.028,10	14.159,26	(4.386.116,67)
RENT9	20.809,30	125.463,16	(7.457,99)	-0,02%	576,28	2,22	(758,29)
RRRP3	475.462,50	81.666,27	29.417,43	0,09%	236.791,35	765,74	(211.198,89)
SANB11	540.209,20	33.862,59	13.838,93	0,04%	51.473,55	195,30	(65.626,54)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	606.112.793,73	VAR / PL:	5,524%
VAR:	33.482.770,20	ETL / PL:	6,9275%
ETL:	41.988.759,04	VAR / CDI:	10876,93%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	1.398.924,78	BAIXA 1:	(502.963,71)	Cenário 1:	115.340.190,07
				Cenário 2:	487.471,41
				Cenário 3:	(115.768.174,23)

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
SBSP3	3.506.414,30	642.388,77	210.198,73	0,63%	2.177.086,13	6.746,04	(1.772.098,02)
SLCE3	225.706,40	28.414,10	9.511,52	0,03%	(25.038,62)	(107,24)	42.516,47
SMT03	154.888,71	24.263,58	14.695,82	0,04%	(7.126,43)	(29,73)	11.338,26
SOMA3	5.451.933,76	810.715,05	515.667,56	1,54%	846.159,41	3.132,13	(1.019.077,43)
STBP3	3.979.430,00	587.690,62	253.902,87	0,76%	302.659,76	1.156,64	(392.389,13)
SULA11	1.038.255,84	196.067,07	116.075,03	0,35%	(155.361,85)	(679,26)	277.554,24
SUZB3	15.361.553,20	3.409.427,94	1.001.785,65	2,99%	5.912.420,60	19.938,21	(5.777.792,46)
TAEE11	448.038,12	36.942,32	17.242,71	0,05%	(26.098,71)	(109,22)	41.866,84
TEND3	526.176,00	244.902,11	2.755,71	0,01%	(142.617,85)	(671,44)	306.896,25
TIMS3	3.623.914,80	332.282,83	38.114,61	0,11%	534.623,77	1.985,36	(648.668,56)
TOTS3	4.775.040,00	471.501,37	427.106,85	1,28%	1.077.146,19	3.871,05	(1.212.941,45)
UGPA3	4.019.982,75	568.640,51	446.899,67	1,33%	59.341,31	224,16	(74.753,05)
USIM5	189.968,25	22.833,14	17.086,02	0,05%	(5.512,15)	(23,00)	8.762,36
VALE3	48.282.514,07	5.303.559,15	(229.752,98)	-0,69%	11.765.120,76	41.965,99	(13.026.419,05)
VBBR3	7.579.973,25	747.225,88	562.840,49	1,68%	239.340,29	807,30	(316.020,29)
VIIA3	251.742,77	61.169,87	32.085,31	0,10%	52.701,98	26,81	(60.261,61)
VIVT3	904.936,86	47.804,83	18.522,59	0,06%	(27.578,25)	(115,03)	43.803,62
WEGE3	9.944.125,00	1.459.530,47	549.427,04	1,64%	4.972.233,22	16.067,77	(4.427.983,75)
YDUQ3	1.825.851,48	392.899,59	70.201,46	0,21%	692.250,39	2.339,59	(679.768,81)
INDZ22	-	285.631,89	282.247,73	0,84%	-	-	-
DOLZ22	-	476.175,58	416.675,79	1,24%	4.014,87	103.461,44	(9.014,61)
COMPROMISSADA	25.220.406,45	4.817,16	1.540,03	0,00%	700.423,42	1.657,69	(922.073,39)
EMP AÇÃO PROVISÃO	16.388,91	15,89	8,93	0,00%	541,54	(34,58)	(692,61)
LFT	988.446,39	261,22	70,94	0,00%	27.373,24	105,27	(36.019,06)
Total	605.486.399,75	69.968.804,00	33.482.770,20	100,00%	115.340.190,07	487.471,41	(115.768.174,23)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FI RF EMB II CNPJ - 11005764000196

Dados Gerais

PL:	2.258.975.584,37	VAR / PL:	2,077%
VAR:	46.924.606,92	ETL / PL:	2,6050%
ETL:	58.845.370,36	VAR / CDI:	4090,04%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(145.655.928,71)	BAIXA 1:	231.045.992,96	Cenário 1:	181.809.352,23
				Cenário 2:	(63.456.414,06)
				Cenário 3:	(306.037.946,69)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	5.000,00	82,93	59,63	0,00%	(36,57)	(0,14)	50,13
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(63.976,56)	1.061,14	(762,98)	0,00%	467,94	1,83	(641,41)
COMPROMISSADA	354.842.066,45	5.887.393,02	4.232.493,50	9,02%	(2.567.379,26)	(24.624,43)	3.514.758,27
DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17	29.968.704,89	641.527,44	365.218,19	0,78%	827.680,01	(21.584,71)	(1.801.600,56)
DE252 CSMG IPCA - CSMGC3	12.024.889,33	253.683,27	164.883,71	0,35%	66.695,62	(56.034,94)	(206.565,02)
DE252 PETR IPCA - PETR45	13.101.213,14	286.400,43	178.472,28	0,38%	64.253,79	(58.073,28)	(212.192,60)
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	5.247.367,68	85.169,79	62.379,68	0,13%	(25.142,89)	(4.959,82)	23.645,56
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	7.462.826,27	170.754,29	106.251,99	0,23%	58.614,90	(40.924,11)	(165.903,44)
DEBI ELETROB IPCA - ELET42	10.982.432,42	229.777,66	183.201,55	0,39%	347.893,59	(146.692,54)	(741.645,21)
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	10.669.265,99	215.285,82	182.605,54	0,39%	359.634,83	(155.523,50)	(730.676,01)
DEBI IGUA SAN IPCA - IGSN15	2.076.069,09	43.851,23	36.930,88	0,08%	83.334,84	(33.458,93)	(164.781,70)
DEBI NEOENERG IPCA - NEOE16	5.455.813,03	117.545,06	92.061,45	0,20%	181.764,38	(74.527,33)	(392.324,92)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GU	890.567,71	15.192,18	11.158,68	0,02%	(6.300,92)	(102,74)	8.463,89
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001GZ	4.452.838,56	75.960,90	55.793,39	0,12%	(31.504,62)	(513,72)	42.319,47
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H2	10.686.812,55	182.306,16	133.904,14	0,29%	(75.611,08)	(1.232,93)	101.566,74
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H4	8.015.109,41	136.729,62	100.428,10	0,21%	(56.708,31)	(924,70)	76.175,05
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001H6	6.233.973,99	106.345,26	78.110,75	0,17%	(44.106,46)	(719,21)	59.247,26
NTNB	1.614.181.181,64	38.597.449,63	38.064.924,00	81,12%	184.216.706,03	(62.830.293,78)	(307.628.523,18)
BB TOP RF IND PREÇO	217.509.842,52	3.236.443,43	2.876.492,43	6,13%	(1.590.903,59)	(6.225,09)	2.180.680,97
Total	2.313.741.998,12	50.282.959,25	46.924.606,92	100,00%	181.809.352,23	(63.456.414,06)	(306.037.946,69)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FI RF EMB V CREDITO PRIVADO CNPJ - 20726178000121

Dados Gerais

PL:	166.838.739,68	VAR / PL:	1,475%
VAR:	2.461.316,11	ETL / PL:	1,8500%
ETL:	3.086.590,75	VAR / CDI:	2904,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(2.933.807,82)	BAIXA 1:	2.098.529,69	Cenário 1:	1.252.715,86
				Cenário 2:	(694.406,80)
				Cenário 3:	(3.166.753,97)

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	16,59	13,67	0,00%	(7,31)	(0,03)	10,03
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(26.896,28)	446,11	(367,67)	-0,01%	196,72	0,77	(269,65)
COMPROMISSADA	9.646.660,96	160.053,41	131.936,68	5,36%	(69.796,23)	(669,43)	95.551,47
CRI RB CAPIT IPCA M D - 17H0164854	6.663.122,97	139.713,73	139.336,78	5,66%	90.344,62	(49.626,86)	(217.599,35)
DE252 AEGEA SA IPCA - AEGP23	10.940.129,59	259.335,59	256.130,99	10,41%	126.295,99	(74.716,08)	(323.781,82)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.640.775,34	105.861,49	104.858,93	4,26%	29.996,95	(23.095,61)	(89.564,02)
DE252 CEMIG - IPCA CMDT33	1.998.867,10	41.433,84	41.251,29	1,68%	8.916,20	(8.544,83)	(30.557,19)
DE252 COMGAS IGPM-100 - GASP17	6.200.421,70	132.729,82	97.236,58	3,95%	171.244,14	(4.465,80)	(372.744,94)
DE252 DUKE GEP - IPCA GEPA24	7.282.438,00	134.538,83	132.933,00	5,40%	(108,40)	(19.481,74)	(42.718,33)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	9.544.478,90	224.021,79	221.429,18	9,00%	102.976,40	(62.685,99)	(267.460,77)
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV36	3.093.850,22	70.574,33	69.905,95	2,84%	19.997,96	(15.397,07)	(59.709,35)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	1.072.214,08	17.403,06	16.596,95	0,67%	(5.137,54)	(1.013,46)	4.831,59
DE252 RD COLIN - IPCA RDCO34	3.133.971,60	52.456,77	50.510,68	2,05%	(8.098,82)	(5.473,65)	(983,68)
DE252 SABESP - IPCA SBESC7	122.031,81	1.980,69	1.888,95	0,08%	(584,72)	(115,34)	549,90
DE252 SABESP IPCA - SBSPC2	5.719.215,93	130.859,36	129.584,10	5,26%	44.920,15	(31.362,62)	(127.141,85)
DE252 TRANS AL - IPCA TAEE33	7.765.098,79	180.737,42	178.620,79	7,26%	52.006,26	(39.478,87)	(156.333,41)
DEBI ENERGMIR IPCA - ENMI21	913.958,80	19.902,83	19.798,44	0,80%	13.809,27	(7.333,65)	(32.908,60)
DEBI ENTREVIA IPCA - ENTV12	14.025.639,25	283.011,15	269.530,28	10,95%	472.769,95	(204.448,60)	(960.534,51)
DEBI JAGUARA IPCA - ENJG21	1.482.079,70	32.238,41	32.091,53	1,30%	21.096,82	(11.435,53)	(50.814,18)
LFS ITAU IPCA M D - LFS012001IP	8.925.843,87	155.719,59	139.141,22	5,65%	(60.872,25)	(1.858,74)	79.833,19
LFSN BRADESCO IPCA - LFSN16000GM	13.063.661,77	336.590,32	329.195,21	13,37%	170.011,73	(95.906,76)	(436.650,51)
LFSN BRADESCO IPCA M D - LFSN1800DC5	4.222.417,04	101.603,44	99.692,58	4,05%	72.737,96	(37.296,91)	(177.757,96)
Total	120.430.981,14	2.581.228,59	2.461.316,11	100,00%	1.252.715,86	(694.406,80)	(3.166.753,97)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIM EMB I A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	269.414.020,63	VAR / PL:	0,305%
VAR:	822.693,41	ETL / PL:	0,3829%
ETL:	1.031.691,08	VAR / CDI:	601,25%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(320.176,10)	BAIXA 1:	555.460,69	Cenário 1:	(140.049,49)
				Cenário 2:	74.432,39
				Cenário 3:	3.332,56

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	9.000,01	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(26.075,75)	-	-	0,00%	-	-	-
DI1Z22	-	4.888,17	(3.604,28)	-0,44%	44.307,20	(22.871,93)	(67.554,60)
DI1J23	-	34.307,10	(15.563,51)	-1,89%	595.288,70	(305.718,30)	(899.885,97)
DI1F24	-	713.418,81	87.766,52	10,67%	(3.963.748,13)	2.016.707,06	5.899.474,54
DI1F25	-	7.235,24	(3.577,38)	-0,43%	(24.136,86)	12.146,24	35.273,60
DI1F26	-	44.553,59	30.577,56	3,72%	130.221,98	(64.716,53)	(186.405,69)
DI1F27	-	946.493,16	715.623,83	86,99%	2.703.105,69	(1.326.443,52)	(3.789.190,49)
DI1F31	-	97.586,92	(83.077,67)	-10,10%	(288.945,64)	134.428,68	371.155,82
DOLZ22	-	49.601,62	27.906,28	3,39%	418,22	10.777,23	(939,02)
WDOZ22	-	5.952,19	(3.348,75)	-0,41%	(50,19)	(1.293,27)	112,68
COMPROMISSADA	216.418.150,65	2.159,07	(1.690,51)	-0,21%	17.074,35	(8.824,59)	(26.085,21)
DE252 AUTOBAN CDI - ANHB10	723.499,61	69,13	22,70	0,00%	325,21	(164,14)	(477,66)
DE252 BCBF CDI - BCBF14	265.290,03	31,76	4,90	0,00%	171,84	(87,18)	(254,58)
DE252 CONT GLO CDI - CGBP13	2.215.000,09	1.575,63	1.047,37	0,13%	5.412,89	(2.681,72)	(7.710,77)
DE252 ELETROB CDI - ELET13	2.049.050,23	623,01	274,60	0,03%	2.531,35	(1.275,31)	(3.706,67)
DE252 ENERG TR CDI - ETEN13	3.048.014,88	24.795,49	18.209,30	2,21%	90.638,87	(43.903,50)	(124.461,18)
DE252 EQUATENE CDI - EQTL13	1.442.751,54	65,48	(20,76)	0,00%	415,72	(211,77)	(620,02)
DE252 GUARIROB CDI - GRRB14	1.094.255,86	122,01	45,78	0,01%	531,21	(267,88)	(779,07)
DE252 INTERVIA CDI - IVIA35	1.373.706,28	77,04	(5,01)	0,00%	458,06	(232,76)	(680,32)
DE252 MOV_PART CDI - MOV133	1.599.379,31	21,47	(15,12)	0,00%	-	-	-
DE252 OMEGA GE CDI - OMGE13	1.057.189,26	779,61	521,28	0,06%	2.645,94	(1.311,04)	(3.769,84)
DE252 PROLAGOS CDI - PRLG14	3.057.984,66	7.130,92	952,04	0,12%	(40.390,66)	20.583,24	60.276,75
DE252 RT BANDE CDI - CBAN22	1.072.360,89	354,62	175,51	0,02%	1.409,80	(708,16)	(2.054,32)
DE252 VAMOS CDI - VAMO22	1.098.529,57	239,08	90,87	0,01%	1.063,82	(536,89)	(1.562,29)
LF selic	3.347.393,35	46,03	(32,84)	0,00%	-	-	(0,00)
LF252 B.ALFA CDI - LF0021006S0	1.124.314,33	15,09	(10,63)	0,00%	0,00	0,00	-
LF252 BES INV CDI - LF00220018H	1.130.171,16	15,17	(10,69)	0,00%	-	-	-
LF252 DAYCOVAL CDI - LF002100HDP	1.338.987,81	17,97	(12,66)	0,00%	(0,00)	-	(0,00)
LF252 DAYCOVAL CDI - LF002100HDI	2.439.286,77	32,74	(23,07)	0,00%	-	-	-
LFT	20.386.907,60	1.522,91	1.244,13	0,15%	(0,00)	-	-
LFV TOYOTA CDI - LF002100ISJ	2.500.761,32	33,56	(23,65)	0,00%	0,00	-	(0,00)
NTNB	4.660.810,33	109.743,91	44.547,78	5,41%	698.847,18	(221.315,52)	(1.124.874,30)
IDJRDG	49.549,60	77.656,09	(18.291,52)	-2,22%	(49.929,31)	(49.929,31)	19.749.057,77
IDJRDH	348.110,08	213.138,30	(50.228,27)	-6,11%	(349.150,03)	(349.150,03)	19.567.639,34
IDJRDN	(279.915,30)	310.810,18	73.219,30	8,90%	281.433,29	281.433,29	(39.438.645,91)
Total	273.544.464,18	2.655.113,05	822.693,41	100,00%	(140.049,49)	74.432,39	3.332,56



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIM EMB II A CNPJ - 20725957000102

Dados Gerais

PL:	216.878.302,14	VAR / PL:	0,705%
VAR:	1.529.582,43	ETL / PL:	0,8844%
ETL:	1.918.158,73	VAR / CDI:	1388,66%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(6.078.694,16)	BAIXA 1:	6.582.273,29	Cenário 1:	5.404.930,42
				Cenário 2:	(1.941.434,50)
				Cenário 3:	(9.325.628,40)

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	9.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	46.557,59	-	-	0,00%	-	-	-
INDZ22	-	633.963,47	520.300,09	34,02%	-	-	-
WINZ22	-	213.178,93	(174.958,05)	-11,44%	-	-	-
DI1F23	-	1.428,12	90,90	0,01%	16.649,72	(8.583,28)	(25.329,01)
DI1J23	-	137,96	67,98	0,00%	2.393,92	(1.229,43)	(3.618,84)
DI1N23	-	3.253,85	(1.949,50)	-0,13%	(31.220,38)	15.982,36	46.944,18
DI1V23	-	228,83	134,27	0,01%	1.590,31	(811,41)	(2.378,05)
DI1F24	-	65.514,54	(40.890,19)	-2,67%	(363.998,14)	185.197,84	541.759,38
DI1J24	-	7.000,50	4.386,77	0,29%	33.182,08	(16.837,24)	(49.166,02)
DI1N24	-	11.456,17	7.195,42	0,47%	47.342,82	(23.958,20)	(69.835,23)
DI1V24	-	7.489,88	4.609,28	0,30%	27.625,02	(13.941,19)	(40.562,43)
DI1F25	-	36.176,18	21.791,98	1,42%	120.684,32	(60.731,21)	(176.367,98)
DI1N25	-	204.691,01	(122.099,04)	-7,98%	(612.604,67)	306.496,00	886.700,14
DI1F26	-	33.752,72	20.779,47	1,36%	98.653,02	(49.027,68)	(141.216,43)
DI1F27	-	103.164,48	64.416,61	4,21%	294.629,17	(144.577,75)	(413.008,65)
DI1F29	-	146.265,46	87.909,31	5,75%	414.089,80	(197.891,92)	(555.758,10)
DI1F31	-	83.052,69	49.482,46	3,24%	245.911,18	(114.407,39)	(315.877,29)
DI1F33	-	6.082,46	3.708,15	0,24%	18.756,81	(8.496,73)	(23.071,72)
WDOZ22	-	134.916,41	92.898,84	6,07%	1.137,55	29.314,08	(2.554,14)
COMPROMISSADA	49.230.639,14	491,14	(149,45)	-0,01%	3.884,06	(2.007,41)	(5.933,84)
LTN	20.736.576,46	234.017,71	142.190,18	9,30%	766.510,74	(384.395,07)	(1.113.814,78)
DE252 AEGEA SA CDI - AEGP13	673.289,43	10,21	(1,67)	0,00%	17,95	(9,25)	(27,28)
DE252 COPEL GT CDI - CPGT14	150.385,83	59,19	(35,88)	0,00%	(509,72)	262,71	775,15
DE252 COPEL GT CDI - CPGT16	299.259,64	102,07	(65,71)	0,00%	(515,77)	263,73	774,08
DE252 ECORODOV CDI - ERDV18	1.831.652,21	16.760,61	10.235,66	0,67%	47.265,04	(22.809,79)	(64.462,20)
LF selic	4.153.728,02	936,94	(589,68)	-0,04%	(3.879,22)	2.014,99	5.976,15
LFT	50.254.158,10	5.976,75	(2.659,60)	-0,17%	-	-	-
NTNB	90.605.181,21	977.035,92	842.783,84	55,10%	4.277.334,83	(1.431.251,27)	(7.805.575,49)
Total	217.990.427,63	2.927.144,21	1.529.582,43	100,00%	5.404.930,42	(1.941.434,50)	(9.325.628,40)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIM EMB VI A CRED PRIV CNPJ - 41837660000109

Dados Gerais

PL:	170.621.067,91	VAR / PL:	1,901%
VAR:	3.242.721,96	ETL / PL:	2,3834%
ETL:	4.066.505,56	VAR / CDI:	3742,10%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(4.745.503,74)	BAIXA 1:	3.837.574,36	Cenário 1:	2.462.774,33
				Cenário 2:	(1.507.873,47)
				Cenário 3:	469.278.842.931,18

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	10.000,00	165,86	148,25	0,00%	(73,14)	(0,29)	100,26
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(49.864,45)	827,07	(739,22)	-0,02%	364,72	1,43	(499,92)
DAPK23	-	237.748,74	45.618,04	1,41%	174.150,46	(63.243,77)	(380.570,45)
DAPQ24	-	589.452,55	279.071,78	8,61%	557.666,91	(201.028,22)	(1.197.743,02)
DIH25	-	95.866,89	(13.516,52)	-0,42%	319.813,44	(160.937,72)	(467.375,15)
DAPK25	-	197.033,55	72.198,35	2,23%	-	-	-
DIH25	-	1.163,02	(236,36)	-0,01%	3.480,71	(1.741,45)	(5.038,07)
DIH26	-	8.100,65	1.839,12	0,06%	(23.676,72)	11.766,64	33.891,94
DAPQ26	-	198.332,95	57.265,07	1,77%	-	-	-
DAPK27	-	16.297,00	3.769,50	0,12%	-	-	-
DAPQ28	-	144.047,69	(33.260,24)	-1,03%	-	-	-
DAPQ30	-	0,62	(0,19)	0,00%	(2,50)	0,87	4,95
DAPK35	-	7.801,82	(1.999,41)	-0,06%	-	-	-
COMPROMISSADA	31.769.538,61	527.107,06	471.159,31	14,53%	(229.861,29)	(2.204,66)	314.681,54
DE252 1V11 CDI - VECS11	4.270.370,72	74.934,15	52.137,34	1,61%	150.781,26	(86.777,55)	(200.251,91)
DE252 AEGEA SA CDI - AEGPA1	1.922.440,70	31.258,56	28.001,77	0,86%	(6.261,67)	(3.908,27)	8.214,78
DE252 ALIANSCA CDI - ALSA0	2.564.082,53	41.349,91	32.654,84	1,01%	41.855,96	(30.048,17)	(60.351,23)
DE252 AMBIPAR CDI - AMBP13	2.796.269,17	46.293,82	41.601,81	1,28%	(17.006,51)	(2.267,32)	20.890,19
DE252 AUTOPIST CDI - APRB28	1.369.391,07	22.677,98	20.287,79	0,63%	(9.332,68)	(382,27)	12.734,05
DE252 BCBF CDI - BCBF15	2.733.209,80	45.281,50	40.529,71	1,25%	(18.151,89)	(1.010,57)	24.681,40
DE252 BKBR CDI - BKBR18	1.431.340,10	23.742,41	21.239,55	0,65%	(10.022,80)	(268,21)	13.685,00
DE252 BRKA CDI - BRKA0	2.391.189,36	39.234,49	35.168,04	1,08%	(11.421,53)	(3.102,45)	15.198,40
DE252 BRML CDI - BRML17	3.181.653,59	53.486,56	47.628,69	1,47%	(31.063,93)	3.851,54	43.389,14
DE252 CCPR CDI - CCPRA3	2.128.653,57	36.335,73	32.506,95	1,00%	(20.179,09)	2.190,79	27.748,64
DE252 CEA MODA CDI - CEAB11	1.791.843,58	29.705,51	26.584,50	0,82%	(12.158,13)	(532,83)	16.556,97
DE252 CEA MODA CDI - CEAB22	573.928,09	9.435,23	8.455,26	0,26%	(2.988,84)	(620,39)	4.008,13
DE252 CM HOSPI CDI - VVEO15	4.199.289,77	74.364,17	48.868,73	1,51%	156.380,54	(89.016,04)	(206.896,57)
DE252 CORSAN CDI - RSAN24	1.653.220,89	26.233,77	22.444,23	0,69%	16.757,41	(14.593,71)	(25.694,78)
DE252 COSAN LO CDI - RLOG11	1.549.178,00	25.674,24	22.978,17	0,71%	(10.400,52)	(516,66)	14.151,89
DE252 CSAN CDI - CSAN23	1.141.336,77	18.434,28	16.480,26	0,51%	(2.366,53)	(2.945,60)	3.158,29
DE252 DASA CDI - DASAA2	2.773.436,40	46.013,50	41.149,31	1,27%	(19.782,29)	(335,76)	27.054,73
DE252 ECORODOV CDI - ERDVA0	2.147.718,01	35.644,64	31.866,83	0,98%	(15.572,94)	(131,45)	21.325,86
DE252 ELEKTRO CDI - ELEK27	582.793,32	9.673,19	8.632,29	0,27%	(4.945,61)	336,20	6.885,81
DE252 ENER G TR CDI - ETEN13	4.772.168,87	76.727,32	62.400,05	1,92%	107.005,62	(68.874,74)	(147.020,29)
DE252 GGSB PAR CDI - GGSB12	2.412.767,17	39.919,27	35.754,74	1,10%	(15.055,37)	(1.380,52)	20.367,12
DE252 GUAR CDI - GUAR15	2.804.672,26	46.237,68	41.430,51	1,28%	(15.829,96)	(2.432,72)	21.295,03
DE252 IGUATEMI CDI - IGTA37	2.116.508,86	35.455,61	31.516,15	0,97%	(20.829,98)	2.660,30	29.177,38
DE252 LIGHT CDI - LIGHB4	2.064.518,33	34.256,37	30.637,93	0,94%	(14.623,06)	(302,99)	19.982,51
DE252 LIGHT CDI - LIGHD3	1.630.797,40	26.658,94	23.886,02	0,74%	(7.073,68)	(2.453,84)	9.424,84
DE252 LOCAMERI CDI - LCAMA9	1.980.530,00	32.769,11	29.348,16	0,91%	(12.451,83)	(1.085,97)	16.855,90
DE252 MOV_PART CDI - MOV127	1.186.607,14	19.233,68	17.225,81	0,53%	(3.012,87)	(2.832,56)	3.865,85
DE252 MULTIPLA CDI - MULP16	3.289.296,15	54.828,84	48.793,47	1,50%	(29.553,39)	2.712,10	41.207,14
DE252 NTRASSUD CDI - NTS035	1.870.509,75	30.137,90	26.915,92	0,83%	(2.880,23)	(5.282,86)	3.935,71
DE252 OMEGA GE CDI - OMEG13	3.965.244,01	64.976,15	58.209,45	1,80%	(19.078,22)	(5.030,85)	25.614,50
DE252 OURO VER CDI - OVSA10	1.587.731,37	26.229,13	23.497,04	0,72%	(9.519,44)	(1.101,60)	12.845,59
DE252 RD COLIN CDI - RDCO10	3.374.342,55	53.694,06	45.295,53	1,40%	39.213,87	(32.368,79)	(59.985,37)
DE252 RENNER CDI - LRENB1	1.402.454,12	23.261,43	20.808,93	0,64%	(9.797,99)	(274,18)	13.375,69
DE252 RT BANDE CDI - CBAN22	2.230.728,39	36.824,26	32.980,49	1,02%	(13.383,25)	(1.536,95)	18.091,13



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIM EMB VI A CRED PRIV CNPJ - 41837660000109

Dados Gerais

PL:	170.621.067,91	VAR / PL:	1,901%
VAR:	3.242.721,96	ETL / PL:	2,3834%
ETL:	4.066.505,56	VAR / CDI:	3742,10%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(4.745.503,74)	BAIXA 1:	3.837.574,36	Cenário 1:	2.462.774,33
				Cenário 2:	(1.507.873,47)
				Cenário 3:	469.278.842.931,18

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 S LUIZ A CDI - RDORB9	1.129.507,10	18.259,77	16.327,25	0,50%	(2.581,45)	(2.798,20)	3.458,39
DE252 SANEAMEN CDI - SNGO18	2.566.123,74	42.526,27	38.059,12	1,17%	(17.265,10)	(836,36)	23.499,68
DE252 SBF COME CDI - SBFC11	3.430.239,51	55.591,77	48.113,63	1,48%	34.334,29	(30.493,76)	(54.727,86)
DE252 UNIGEL P CDI - UGEL11	862.485,24	14.231,56	12.749,08	0,39%	(5.045,43)	(659,37)	6.805,26
DE252 VERT-10 CDI - VCCS11	1.918.774,96	31.165,51	27.904,45	0,86%	(6.166,09)	(3.923,23)	8.169,64
DE252 VIX LOGI CDI - VIXL14	2.082.239,84	34.462,68	30.858,87	0,95%	(13.285,73)	(1.043,30)	18.008,52
LF cdi	2.132.803,88	35.393,02	31.638,90	0,98%	(15.599,69)	(61,04)	21.382,78
LF selic	2.151.650,41	36.297,25	31.995,16	0,99%	(26.301,10)	5.425,91	37.847,67
LF252 ABC CDI - LF002100BMM	1.155.288,83	19.171,55	17.138,04	0,53%	(8.449,98)	(33,06)	11.582,54
LF252 ABC CDI - LF002100BMX	1.155.288,83	19.171,55	17.138,04	0,53%	(8.449,98)	(33,06)	11.582,54
LF252 CNH CDI - LF0021003Q1	2.151.284,21	35.699,69	31.913,05	0,98%	(15.734,85)	(61,57)	21.568,06
LF252 PANAMERI CDI - LF002100E1F	1.153.194,03	19.136,79	17.106,96	0,53%	(8.434,66)	(33,00)	11.561,54
LFSC B.BRASIL CDI - LFSC22002IX	4.692.537,88	76.863,39	68.920,21	2,13%	(20.660,82)	(6.953,85)	27.343,41
LFSN BRADESCO CDI - LFSN210029N	3.796.691,86	63.004,57	56.321,71	1,74%	(27.769,64)	(108,66)	38.064,36
LFT	1.037.720,55	17.356,75	15.483,92	0,48%	(7.590,06)	(29,70)	10.403,84
DE252 LOCAMERI IPCA - LCAMD1	4.258.556,42	89.293,43	84.795,60	2,61%	190.485,25	(76.317,70)	(374.236,71)
DE252 SIMPAR IPCA M D - JSMLB5	2.731.337,04	55.836,60	52.805,97	1,63%	123.625,75	(50.868,76)	(237.811,24)
DE252 VAMOS IPCA - VAMO33	1.260.341,01	26.392,13	25.159,42	0,78%	54.024,97	(21.748,15)	(107.093,53)
DEBI CART IPCA - CART13	1.633.318,72	34.138,62	32.505,96	1,00%	73.341,79	(29.292,15)	(141.012,64)
DEBI CORSAN IPCA - RSAN44	709.808,62	15.452,97	14.868,25	0,46%	21.300,26	(8.999,36)	(45.644,85)
DEBI GBS PART IPCA - GBSP11	2.316.892,98	51.440,40	45.493,71	1,40%	157.091,36	(58.142,07)	(266.671,86)
DEBI HAZTEC IPCA - HZTC14	2.195.315,06	45.682,40	43.725,66	1,35%	94.771,84	(38.013,53)	(182.756,07)
DEBI HOLDARAG IPCA - HARG11	2.947.813,73	62.888,68	59.428,44	1,83%	146.489,73	(56.823,90)	(273.847,54)
DEBI METRORIO IPCA - MTRJ19	2.732.188,25	55.770,16	54.412,37	1,68%	80.044,21	(35.206,47)	(165.176,17)
DEBI NORTE EN IPCA - NTEN11	2.842.540,22	58.797,53	57.228,40	1,76%	81.026,83	(36.139,38)	(170.181,50)
DEBI PARANAGU IPCA - PASN12	1.781.775,66	36.984,28	36.011,65	1,11%	39.312,68	(18.331,41)	(86.302,61)
DEBI UTE GNA IPCA - UNEG11	4.519.156,51	97.649,27	91.103,79	2,81%	246.923,28	(91.010,72)	(450.943,41)
NTNB	8.789.213,66	161.561,35	147.433,10	4,55%	463.605,05	(178.170,70)	(891.241,87)
BR ELETRO FIDC S1	13.727,61	80.871,03	(24.856,03)	-0,77%	(13.827,98)	(0,39)	469.283.807.378,06
FARM SYN AGRO FIDC	1.072.399,83	30.910,67	29.119,52	0,90%	25.014,05	(30,69)	(32.338,86)
FIDC VERDECARD SN4	2.100.002,02	34.381,70	30.339,49	0,94%	(109.690,81)	(60,10)	156.390,75
RB CAP CREDIT AL SN4	827.234,00	13.829,90	12.244,56	0,38%	(10.876,68)	(23,68)	14.897,24
Total	183.767.348,15	4.785.142,09	3.242.721,96	100,00%	2.462.774,33	(1.507.873,47)	469.278.842.931,18



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIM EMB VII A CRED PRIV CNPJ - 41687175000104

Dados Gerais

PL:	308.716.523,56	VAR / PL:	1,896%
VAR:	5.852.282,26	ETL / PL:	2,3773%
ETL:	7.339.000,58	VAR / CDI:	3732,54%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(14.823.838,56)	BAIXA 1:	11.627.305,55	Cenário 1:	10.116.566,71
				Cenário 2:	(4.331.581,34)
				Cenário 3:	(19.737.411,88)

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	16,59	12,59	0,00%	(7,31)	(0,03)	10,03
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(149.759,17)	2.483,96	(1.885,57)	-0,03%	1.095,36	4,29	(1.501,44)
CNRD11	78.302,00	1.298,75	985,87	0,02%	(572,71)	(2,24)	785,03
COMPROMISSADA	5.419.743,29	89.922,14	68.266,49	1,17%	(39.213,32)	(376,11)	53.683,28
DE252 ECORODOV IPCA - ERDV17	2.761.535,89	64.816,97	60.405,16	1,03%	29.794,50	(18.137,15)	(77.385,32)
DE252 IRB IPCA - IRBR12	9.291.743,91	199.281,77	195.074,83	3,33%	190.302,69	(92.343,39)	(431.985,22)
DE252 LIGHT IPCA - LIGHD7	4.509.241,81	100.959,53	98.019,36	1,67%	91.999,02	(44.269,08)	(213.328,28)
DE252 LOCALIZA IPCA - LORTA7	5.126.342,42	110.441,78	110.036,58	1,88%	233.255,67	(90.864,94)	(463.933,46)
DE252 LOCAMERI IPCA - LCAMD1	4.202.130,55	88.110,29	87.713,46	1,50%	187.961,32	(75.306,49)	(369.278,07)
DE252 MOV_PART IPCA - MOVI37	1.113.889,11	22.891,61	22.705,99	0,39%	50.289,39	(20.576,77)	(97.178,07)
DE252 MOVIDA L IPCA - MVLV16	6.452.048,97	136.511,74	134.694,06	2,30%	290.060,66	(118.969,33)	(621.601,01)
DE252 VAMOS IPCA - VAMO33	5.340.428,00	111.831,07	111.470,95	1,90%	228.919,38	(92.153,20)	(453.786,16)
DE252 VAMOS IPCA - VAMO34	6.046.690,67	124.381,88	123.292,65	2,11%	276.373,47	(112.943,61)	(532.529,43)
DEBI AESTUCAN IPCA - TCII11	9.473.707,05	211.308,58	209.800,09	3,58%	506.721,11	(189.225,88)	(932.786,66)
DEBI ANEMUS IPCA - ANEM11	11.972.818,61	243.562,74	241.995,47	4,14%	540.529,20	(214.645,82)	(990.490,04)
DEBI ANET IPCA - ANET11	3.566.818,66	75.199,12	73.291,68	1,25%	66.285,12	(32.399,88)	(151.739,06)
DEBI B2W IPCA - BTOW15	6.616.075,30	138.078,35	137.038,26	2,34%	300.954,02	(121.313,93)	(584.496,88)
DEBI BRISANET IPCA - BRST11	5.634.381,10	122.439,46	119.879,53	2,05%	125.509,37	(58.744,51)	(282.291,43)
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	3.808.272,60	84.993,87	84.618,63	1,45%	188.013,02	(68.385,55)	(375.372,62)
DEBI CAGECE IPCA - CAEC21	9.214.324,60	277.095,95	244.845,47	4,18%	133.013,27	(40.578,23)	(423.818,51)
DEBI CART IPCA - CART13	4.932.622,55	103.098,62	102.668,70	1,75%	221.492,22	(88.462,30)	(425.858,17)
DEBI COMGAS IPCA - GASP19	3.078.534,65	66.427,77	66.283,50	1,13%	134.535,93	(56.372,21)	(271.059,53)
DEBI CORSAN IPCA - RSAN44	4.560.520,35	99.285,31	98.377,20	1,68%	136.854,16	(57.820,87)	(293.268,14)
DEBI CTEEP IPCA - CTEE29	5.159.908,68	113.941,58	113.228,08	1,93%	267.369,94	(96.541,26)	(493.200,65)
DEBI EDPM IPCA - MGSP12	4.494.563,16	100.802,46	100.500,21	1,72%	205.196,35	(74.806,45)	(402.140,93)
DEBI ENERGISA IPCA - ENGIA5	5.411.906,46	114.631,64	114.203,72	1,95%	243.723,95	(96.572,92)	(481.147,70)
DEBI ENGIE IPCA - EGIEA0	6.904.169,37	162.223,74	158.025,77	2,70%	472.686,32	(164.086,92)	(819.762,29)
DEBI GBS PART IPCA - GBSP11	7.113.030,56	157.925,79	150.466,73	2,57%	482.281,94	(178.500,41)	(818.702,08)
DEBI HIDRO BR IPCA - HBSA21	4.050.320,49	85.867,55	85.554,75	1,46%	182.326,35	(72.178,12)	(360.193,52)
DEBI HOLDARAG IPCA - HARG11	8.750.352,33	186.680,08	185.394,87	3,17%	434.843,19	(168.677,26)	(812.894,81)
DEBI IP SUL C IPCA - IPIL11	4.102.096,30	83.910,45	83.720,44	1,43%	131.426,60	(56.226,58)	(259.502,46)
DEBI LAME IPCA - LAMEA6	6.590.925,47	136.459,80	135.297,90	2,31%	300.828,38	(122.430,56)	(582.413,83)
DEBI METRORIO IPCA - MTRJ19	8.060.362,79	164.530,28	163.899,32	2,80%	236.142,36	(103.864,33)	(487.294,33)
DEBI MG050 IPCA - CRMG15	4.155.999,64	87.240,97	86.721,54	1,48%	118.665,70	(51.613,21)	(250.181,69)
DEBI NORTE EN IPCA - NTEEN11	5.500.943,81	113.786,22	113.193,12	1,93%	156.804,84	(69.937,68)	(329.338,84)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS11	3.200.356,33	68.206,30	66.588,17	1,14%	63.598,09	(30.804,88)	(143.950,04)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS21	3.314.486,27	70.241,18	68.440,17	1,17%	186.939,90	(72.788,66)	(341.110,48)
DEBI PAMPASUL IPCA - UTPS22	2.456.678,01	52.714,70	52.489,00	0,90%	116.039,72	(45.029,47)	(227.597,14)
DEBI PARANAGU IPCA - PASN12	6.273.407,22	130.217,00	128.203,50	2,19%	138.415,00	(64.542,58)	(303.860,59)
DEBI PETRJ IPCA - PEJA11	10.512.694,26	215.223,96	214.479,12	3,66%	439.454,33	(181.293,67)	(861.644,93)
DEBI QUATA IPCA - QUAT12	4.051.683,44	89.159,45	85.903,58	1,47%	66.309,05	(34.676,95)	(156.418,12)
DEBI RT BANDE IPCA - CBAN32	3.769.243,68	81.822,96	81.609,74	1,39%	175.530,89	(66.960,38)	(346.599,88)
DEBI RT BANDE IPCA - CBAN72	4.641.277,21	100.753,12	100.490,57	1,72%	216.140,85	(82.452,00)	(426.787,51)
DEBI TAUBATE IPCA - LTTE15	7.603.487,67	169.558,69	169.171,10	2,89%	354.386,74	(133.125,75)	(689.512,75)
DEBI TESC IPCA - CJEN13	10.979.724,98	224.758,05	222.699,10	3,81%	503.659,47	(205.848,01)	(944.012,23)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIM EMB VII A CRED PRIV CNPJ - 41687175000104

Dados Gerais

PL:	308.716.523,56	VAR / PL:	1,896%
VAR:	5.852.282,26	ETL / PL:	2,3773%
ETL:	7.339.000,58	VAR / CDI:	3732,54%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(14.823.838,56)	BAIXA 1:	11.627.305,55	Cenário 1:	10.116.566,71
				Cenário 2:	(4.331.581,34)
				Cenário 3:	(19.737.411,88)

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 TRBR IPCA - CONX12	9.343.634,00	189.854,22	189.413,87	3,24%	291.863,17	(128.628,15)	(606.282,49)
DEBI TUCANOHO IPCA - TNHL11	5.439.751,14	121.299,43	120.540,79	2,06%	285.164,75	(108.691,51)	(523.770,04)
DEBI UHESIMAO IPCA - UHSM12	8.886.272,21	205.748,36	203.268,96	3,47%	437.940,06	(147.558,11)	(870.182,20)
DEBI VENSJOR IPCA - VSJH11	1.150.614,69	23.132,77	22.769,83	0,39%	22.932,38	(11.423,36)	(50.311,81)
DEBI VIA BRAS IPCA - VIMT13	6.136.012,63	129.929,45	129.675,31	2,22%	269.966,22	(105.916,89)	(520.062,65)
DEBI VIARONDO IPCA - VRDN12	3.877.439,05	83.199,40	83.126,77	1,42%	165.406,85	(64.682,11)	(327.309,50)
FIDC CELG DIST SN B	1.624.129,17	47.191,39	2.024,91	0,03%	(388.540,29)	(1.716,34)	716.700,87
FIDC CREDZ SN3	211.780,16	3.512,66	2.666,45	0,05%	(1.549,00)	(6,06)	2.123,24
FIDC VERDECARD SN4	3.700.670,22	60.588,20	45.129,02	0,77%	(193.299,59)	(105,91)	275.595,25
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	266.449,62	33.677,09	(16.205,09)	-0,28%	(160.253,33)	(7,63)	643.563,41
Total	280.785.783,94	6.083.226,77	5.852.282,26	100,00%	10.116.566,71	(4.331.581,34)	(19.737.411,88)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIM EMB III A IMOBILIÁRIO CNPJ - 32711990000162

Dados Gerais

PL:	99.853.689,48	VAR / PL:	2,433%
VAR:	2.429.877,25	ETL / PL:	3,0516%
ETL:	3.047.165,14	VAR / CDI:	4791,36%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(9,82)	BAIXA 1:	9,99	Cenário 1:	3.369.435,20
				Cenário 2:	10.727,58
				Cenário 3:	(4.048.754,86)

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	999,97	27,68	(21,78)	0,00%	11,12	0,04	(14,91)
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(585.026,64)	16.196,25	12.742,92	0,52%	(6.504,90)	(25,22)	8.725,01
AIEC11	4.167.215,61	177.436,65	130.284,77	5,36%	44.414,08	179,65	(59.537,24)
BMLC11	2.437.164,24	156.180,94	(114.928,73)	-4,73%	180.153,84	105,07	(229.942,09)
BPML11	1.085.891,66	97.834,27	(50.479,64)	-2,08%	141.593,65	523,96	(170.364,45)
BTLG11	3.914.574,48	59.359,70	10.128,98	0,42%	595,21	0,47	721,30
CEOC11	869.185,70	37.960,22	(27.711,95)	-1,14%	20.950,27	81,19	(28.067,69)
CNES11	478.255,80	38.193,23	9.384,31	0,39%	(41.682,42)	(172,22)	65.050,78
GALG11	2.775.933,60	34.492,38	4.196,95	0,17%	66.408,33	119,67	(88.979,84)
GTLG11	209.720,00	6.404,07	(5.470,49)	-0,23%	1.942,75	9,04	(2.597,80)
HBRH11	2.524.486,38	137.560,04	49.795,87	2,05%	215.157,17	108,83	(271.366,72)
HSML11	9.785.503,00	648.666,04	617.646,20	25,42%	424.602,31	1.633,67	(559.312,30)
MALL11	61.762,40	1.438,00	(337,56)	-0,01%	2.842,91	10,93	(3.735,04)
MALL13	661.468,58	18.312,52	(14.407,96)	-0,59%	7.354,86	28,52	(9.865,05)
MALL14	2.910.574,59	80.578,22	(63.397,46)	-2,61%	32.362,64	125,48	(43.407,91)
MAXR11	1.437.368,32	88.151,45	38.166,34	1,57%	(62.339,66)	(251,98)	92.278,34
NEWL11	146.131,81	4.422,55	3.368,46	0,14%	1.624,84	6,30	(2.179,39)
NEWU11	457.392,72	45.867,37	(33.281,68)	-1,37%	99.748,69	19,72	(109.991,94)
PATC11	10.747.285,00	342.019,25	100.620,13	4,14%	1.166.106,99	4.357,74	(1.435.261,83)
QAGR11	8.502.525,00	278.628,81	(216.650,77)	-8,92%	512.973,19	366,55	(664.136,15)
RBRL11	3.224.563,65	225.107,89	148.876,08	6,13%	(139.917,31)	139,01	207.117,37
RCRB11	5.885.460,00	339.857,71	178.980,33	7,37%	524.225,65	1.976,33	(658.508,53)
RNGO11	130.152,16	14.220,51	12.011,16	0,49%	(13.005,42)	(54,10)	20.634,45
TEPP11	9.644.902,90	733.939,85	680.352,67	28,00%	309.059,88	1.194,53	(411.480,06)
TRXF11	13.548.971,20	913.199,47	775.805,88	31,93%	(136.900,83)	(548,98)	198.705,22
TRXF13	3.244.035,93	89.809,98	(70.660,84)	-2,91%	36.070,39	139,85	(48.381,11)
XPIN11	3.629.892,00	250.879,62	93.974,69	3,87%	150.446,84	156,49	(198.556,48)
XPPR11	3.280.326,40	199.188,41	130.573,82	5,37%	(401.065,45)	141,42	655.523,62
COMPROMISSADA	352.399,57	9.758,57	(7.677,94)	-0,32%	3.946,13	0,82	(5.298,11)
FII HSI LOGISTICA	2.780.932,77	99.006,32	65.375,82	2,69%	167.061,43	119,89	(216.349,23)
FII VIA PQ SHOPPING	1.253.665,00	40.721,95	(27.381,33)	-1,13%	61.198,02	234,92	(80.177,05)
Total	99.563.713,80	5.185.419,94	2.429.877,25	100,00%	3.369.435,20	10.727,58	(4.048.754,86)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	248.625.949,16	VAR / PL:	5,504%
VAR:	13.684.972,20	ETL / PL:	6,9025%
ETL:	17.161.513,12	VAR / CDI:	10837,67%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(207,33)	BAIXA 1:	211,08	Cenário 1:	44.386.395,50
				Cenário 2:	145.457,87
				Cenário 3:	(43.656.787,25)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	10.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	370.999,71	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	8.804.880,00	677.368,38	298.612,12	2,18%	(21.574,22)	(84,21)	29.402,14
AMER3	2.296.019,46	652.928,98	51.954,05	0,38%	249.038,78	-	(299.825,81)
B3SA3	11.653.428,16	1.099.813,44	749.268,69	5,48%	4.021.907,19	13.478,04	(3.864.501,48)
Banco BTG Pactual SA UNT	5.802.470,00	617.103,21	446.769,48	3,26%	880.221,97	3.195,92	(1.013.302,48)
BBAS3	6.167.532,00	859.468,16	549.317,86	4,01%	108.397,49	418,95	(144.306,72)
BBDC4	15.802.204,80	1.238.935,75	713.529,50	5,21%	1.535.085,61	5.712,66	(1.870.521,03)
BEEF3	1.199.736,00	192.922,97	80.526,56	0,59%	(134.273,81)	(555,04)	209.986,83
CIEL3	3.207.050,00	491.306,03	375.965,48	2,75%	739.500,92	2.595,34	(787.956,47)
CPFE3	4.197.270,00	375.672,08	204.359,49	1,49%	(176.821,55)	(704,25)	252.811,88
CSAN3	2.365.458,00	392.195,27	280.273,23	2,05%	(451.790,64)	(1.953,82)	789.548,40
ELET3	5.152.484,04	609.215,06	364.455,55	2,66%	632.790,91	2.327,43	(750.443,34)
ELET6	3.668.416,00	451.639,14	241.115,61	1,76%	601.925,26	2.173,58	(684.318,64)
ENEV3	690.566,00	90.974,38	25.273,98	0,18%	(156.574,14)	(691,92)	288.820,66
EQTL3	2.117.115,00	225.192,41	44.842,02	0,33%	784.609,30	2.603,65	(737.698,90)
EZTC3	1.414.357,00	176.865,09	51.317,06	0,37%	330.733,64	1.159,16	(351.322,49)
GGBR4	3.324.325,00	308.838,09	107.468,90	0,79%	818.344,84	2.853,47	(859.283,68)
GMAT3	5.203.440,00	1.603.728,01	431.447,10	3,15%	(272.852,84)	(1.092,55)	395.138,78
HAPV3	6.558.926,40	1.479.533,06	603.069,37	4,41%	(525.146,40)	(2.133,64)	787.628,35
HYPE3	4.141.015,00	275.057,91	117.799,41	0,86%	1.000.623,54	3.495,62	(1.055.146,22)
INTB3	2.618.484,00	311.437,27	91.803,33	0,67%	1.206.991,44	-	(1.054.159,19)
ITSA4	6.827.149,50	400.548,96	273.930,61	2,00%	1.847.263,20	6.376,89	(1.896.399,10)
ITUB4	20.305.284,80	1.123.164,00	903.967,29	6,61%	4.797.101,92	16.796,03	(5.084.170,89)
JBSS3	3.918.720,00	393.377,02	205.811,90	1,50%	(745.498,36)	(3.222,55)	1.301.381,27
LREN3	6.005.415,00	604.109,91	370.463,27	2,71%	1.701.510,93	5.843,41	(1.726.610,78)
LWSA3	3.570.831,00	825.895,00	726.306,52	5,31%	1.437.690,09	4.713,32	(1.316.112,11)
MULT3	2.612.276,00	188.052,84	150.153,42	1,10%	315.469,64	1.161,39	(374.924,83)
PETR3	7.942.488,00	1.358.546,20	923.777,72	6,75%	1.424.085,11	5.108,42	(1.594.639,19)
PETR4	13.407.315,79	2.297.377,51	1.563.471,31	11,42%	2.571.346,75	9.174,19	(2.844.111,89)
PETZ3	1.756.380,00	392.658,78	104.917,10	0,77%	(395.950,02)	(1.748,36)	728.914,38
PRI03	5.237.720,00	606.945,54	146.120,79	1,07%	2.464.815,28	7.881,19	(2.136.458,61)
RADL3	4.164.873,00	316.977,83	207.603,34	1,52%	668.005,54	2.416,12	(762.269,86)
RENT3	7.188.026,00	596.652,00	489.014,44	3,57%	1.580.990,96	5.573,49	(1.701.713,00)
SBSP3	2.464.100,00	451.687,77	128.513,55	0,94%	1.461.688,20	4.478,28	(1.155.533,39)
SOMA3	2.556.736,00	379.835,62	246.133,23	1,80%	326.010,29	1.196,54	(384.738,36)
STBP3	3.979.430,00	587.317,25	220.914,41	1,61%	192.456,63	732,81	(247.378,40)
SUZB3	5.889.240,00	1.307.724,36	333.120,33	2,43%	2.103.584,12	7.016,59	(2.000.458,54)
TIMS3	3.079.560,00	282.751,13	13.556,50	0,10%	369.034,11	1.359,15	(439.011,48)
TOTS3	3.895.736,28	384.276,73	342.143,40	2,50%	770.908,82	2.743,30	(847.622,41)
VALE3	32.712.113,35	3.597.205,09	202.230,83	1,48%	7.065.139,38	24.948,61	(7.633.558,57)
WEGE3	6.899.964,00	1.013.376,06	303.684,95	2,22%	3.259.018,40	10.414,13	(2.821.025,01)
COMPROMISSADA	7.442.634,08	74,25	(31,47)	0,00%	587,19	(303,48)	(897,07)
Total	248.622.169,37	29.238.748,51	13.684.972,20	100,00%	44.386.395,50	145.457,87	(43.656.787,25)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	111.569.798,80	VAR / PL:	5,876%
VAR:	6.555.312,68	ETL / PL:	7,3681%
ETL:	8.220.629,39	VAR / CDI:	11568,72%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.581.243,11)	BAIXA 1:	1.295.392,70	Cenário 1:	15.513.141,99
				Cenário 2:	147.417,66
				Cenário 3:	(12.675.178,62)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(2.184.178,94)	-	-	0,00%	-	-	-
ALSO3	2.916.166,00	256.615,18	88.990,46	1,36%	1.004.260,83	3.366,42	(965.580,26)
AURE3	7.622.523,56	542.712,87	242.945,35	3,71%	-	-	-
B3SA3	1.189.664,00	112.276,70	77.300,46	1,18%	410.584,61	1.375,93	(394.515,52)
Banco BTG Pactual SA UNT	4.257.074,00	452.747,54	347.751,45	5,30%	645.788,79	2.344,74	(743.425,41)
BBAS3	2.835.732,00	395.169,63	178.145,89	2,72%	49.839,42	192,63	(66.349,91)
BMGB4	141.930,00	19.343,07	8.551,31	0,13%	35.600,85	123,90	(37.219,62)
BRML3	3.725.222,55	257.649,67	93.064,98	1,42%	1.165.515,55	3.955,60	(1.151.864,44)
CLSA3	181.367,00	27.002,07	15.778,50	0,24%	80.280,78	-	(71.142,64)
CSAN3	1.856.286,00	307.774,05	192.874,73	2,94%	(354.541,34)	(1.533,25)	619.595,71
ELET3	4.811.217,04	568.864,62	455.187,21	6,94%	590.878,96	2.173,28	(700.738,86)
ENEV3	6.167.761,16	812.533,82	234.846,25	3,58%	(1.398.435,32)	(6.179,87)	2.579.589,59
ENJU3	176.259,00	40.302,77	13.674,58	0,21%	(29.183,49)	-	49.152,27
EQTL3	9.797.918,13	1.042.180,89	324.731,44	4,95%	3.631.138,47	12.049,58	(3.414.039,10)
EUCATEX PN	135.774,00	17.940,49	6.529,08	0,10%	(22.730,85)	(96,95)	38.385,59
GGBR4	674.650,00	62.676,67	25.606,86	0,39%	166.077,73	579,09	(174.386,00)
GOAU4	1.842.750,00	149.415,61	59.844,92	0,91%	512.960,36	1.765,18	(522.876,18)
HAPV3	2.569.320,00	579.575,63	154.573,97	2,36%	(205.714,94)	(835,81)	308.536,67
IGTH1	4.353.465,44	344.001,64	211.258,75	3,22%	-	-	-
ITSA4	4.497.912,00	263.892,56	189.171,83	2,89%	1.217.027,30	4.201,27	(1.249.399,37)
LREN3	5.463.923,40	549.639,00	334.894,58	5,11%	1.548.090,41	5.316,52	(1.570.927,08)
LWSA3	392.387,00	90.754,91	71.554,58	1,09%	157.983,09	517,93	(144.623,28)
NEXP3	4.543,00	-	-	0,00%	-	-	-
NINJ3	316.680,00	71.405,25	37.982,24	0,58%	139.206,19	-	(123.663,61)
NTCO3	2.576.258,75	473.354,07	151.436,79	2,31%	(343.425,47)	(1.436,56)	552.861,08
ONCO3	1.185.000,00	125.806,53	59.197,09	0,90%	309.079,94	-	(320.156,11)
PETZ3	2.458.056,00	549.526,45	73.222,35	1,12%	(554.132,54)	(2.446,83)	1.020.116,59
PRIQ3	2.473.761,00	286.658,74	129.572,32	1,98%	1.164.125,60	3.722,27	(1.009.043,63)
RDOR3	1.450.867,00	282.068,89	154.269,18	2,35%	(256.797,48)	-	439.681,04
RECV3	4.568.587,52	742.778,47	301.564,12	4,60%	1.296.934,40	-	(1.315.409,46)
RENT3	5.660.693,92	469.873,70	447.929,21	6,83%	1.245.057,53	4.389,22	(1.340.128,21)
RENT9	20.809,30	125.465,97	(1.836,29)	-0,03%	-	-	-
SOMA3	2.530.717,28	375.970,21	190.793,98	2,91%	322.692,63	1.184,36	(380.823,06)
SULA11	692.861,92	130.737,55	71.483,77	1,09%	(122.865,58)	(527,08)	210.468,92
SUZB3	7.499.923,20	1.665.381,66	672.917,84	10,27%	2.678.905,83	8.935,60	(2.547.575,82)
TEND3	526.176,00	244.839,46	(27.213,04)	-0,42%	(157.189,35)	(727,48)	326.070,15
VBBR3	6.542.552,00	644.213,39	470.049,26	7,17%	25.399,18	-	(34.357,57)
YDUQ3	1.582.353,00	340.619,67	103.887,06	1,58%	556.110,36	1.859,05	(531.452,69)
DOLZ22	-	476.175,58	392.801,15	5,99%	4.014,87	103.461,44	(9.014,61)
COMPROMISSADA	7.664.258,62	76,46	(21,51)	0,00%	604,67	(312,52)	(923,78)
Total	111.180.221,85	13.898.021,43	6.555.312,68	100,00%	15.513.141,99	147.417,66	(12.675.178,62)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIA RVA EMB IV CNPJ - 38452613000132

Dados Gerais

PL:	102.668.758,32	VAR / PL:	5,720%
VAR:	5.872.947,39	ETL / PL:	7,1735%
ETL:	7.364.915,49	VAR / CDI:	11263,06%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(156,92)	BAIXA 1:	159,76	Cenário 1:	17.984.378,78
				Cenário 2:	58.947,82
				Cenário 3:	(16.974.309,12)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	2.411.531,43	-	-	0,00%	-	-	-
AURE3	4.051.361,88	288.451,22	149.586,55	2,55%	-	-	-
B3SA3	4.942.820,80	466.487,69	262.756,35	4,47%	1.705.898,58	5.716,73	(1.639.134,69)
Banco BTG Pactual SA UNT	6.386.479,20	679.213,65	553.324,85	9,42%	968.814,89	3.517,59	(1.115.289,73)
BRML3	4.867.077,25	336.624,41	64.633,13	1,10%	1.522.769,21	5.168,07	(1.504.933,77)
ELET3	3.162.125,22	373.880,69	256.588,27	4,37%	388.349,40	1.428,36	(460.553,74)
ELET6	352.978,40	43.457,14	26.567,64	0,45%	57.917,81	209,14	(65.845,78)
ENEV3	1.982.434,90	261.163,71	134.135,42	2,28%	(449.483,52)	(1.986,33)	829.128,80
EQTL3	15.327.522,21	1.630.351,52	154.888,09	2,64%	5.680.426,67	18.849,94	(5.340.803,98)
GGPS3	5.338.140,84	568.300,60	371.775,85	6,33%	142.353,68	-	(187.536,45)
GMAT3	5.058.060,50	1.558.921,27	661.578,19	11,26%	(265.229,58)	(1.062,02)	384.098,95
HAPV3	4.286.396,40	966.905,98	461.552,84	7,86%	(343.194,22)	(1.394,38)	514.731,70
ITUB4	8.300.051,20	459.108,00	295.900,26	5,04%	1.960.878,26	6.865,60	(2.078.221,46)
LREN3	3.494.728,20	351.549,38	174.336,39	2,97%	990.159,42	3.400,45	(1.004.765,76)
MATD3	1.559.262,00	201.828,51	148.131,50	2,52%	41.886,27	-	(55.168,51)
MULT3	1.874.143,28	134.916,05	99.059,29	1,69%	226.329,57	833,22	(268.984,92)
PETR4	1.240.066,19	212.488,48	127.493,48	2,17%	237.828,38	848,54	(263.056,91)
PRIQ3	9.233.392,56	1.069.962,97	362.474,39	6,17%	4.345.136,26	13.893,48	(3.766.287,83)
RAIL3	9.887.524,74	1.445.991,01	1.166.770,00	19,87%	815.454,92	3.055,34	(1.009.462,20)
UGPA3	3.275.821,62	463.134,48	401.421,96	6,84%	(42.361,65)	(166,23)	58.456,09
COMPROMISSADA	5.632.978,76	56,20	(27,06)	0,00%	444,41	(229,69)	(678,95)
Total	102.665.897,58	11.512.792,96	5.872.947,39	100,00%	17.984.378,78	58.947,82	(16.974.309,12)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	117.169.087,45	VAR / PL:	5,690%
VAR:	6.666.807,45	ETL / PL:	7,1354%
ETL:	8.360.448,37	VAR / CDI:	11203,23%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(2.463,37)	BAIXA 1:	3.040,70	Cenário 1:	17.139.238,34
				Cenário 2:	58.136,24
				Cenário 3:	(15.999.080,51)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	11.052,83	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	296.832,11	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	3.528.695,20	284.937,97	105.328,89	1,58%	(35.803,57)	(140,30)	49.242,37
ALPA4	208.328,16	29.796,23	(251,94)	0,00%	4.551,69	17,56	(6.029,71)
AMER3	460.939,80	135.010,63	(1.555,17)	-0,02%	62.809,86	-	(73.456,39)
ARZZ3	303.712,56	35.318,70	10.025,22	0,15%	39.948,56	146,36	(46.948,74)
ASAI3	763.686,00	81.115,17	31.559,12	0,47%	(10.834,51)	-	14.973,34
AZUL4	247.504,72	55.154,12	31.596,13	0,47%	(5.338,83)	(21,04)	7.444,06
B3SA3	4.268.718,84	379.649,50	232.091,15	3,48%	1.419.979,51	4.781,80	(1.379.223,55)
Banco BTG Pactual SA UNT	1.714.051,62	169.209,17	127.689,03	1,92%	220.947,11	810,42	(260.372,19)
BBAS3	2.797.291,56	386.581,57	276.854,83	4,15%	103.668,65	396,89	(134.963,03)
BBDC3	1.249.141,95	83.552,24	57.955,79	0,87%	160.381,12	588,40	(189.099,11)
BBDC4	5.083.828,66	401.575,37	214.482,00	3,22%	544.767,36	2.017,99	(656.771,73)
BBSE3	1.004.503,20	104.005,53	35.548,93	0,53%	(47.211,20)	(188,51)	67.908,84
BEEF3	179.361,00	29.265,77	12.680,35	0,19%	(22.373,36)	(93,14)	35.598,87
BPAN4	126.476,46	14.244,22	8.177,69	0,12%	270,59	1,05	(366,78)
BRAP4	305.551,16	44.557,66	5.024,33	0,08%	97.282,44	329,44	(95.676,83)
BRFS3	678.150,85	116.084,85	58.845,25	0,88%	(125.568,04)	(541,16)	217.568,06
BRKM5	440.201,12	126.074,75	29.758,59	0,45%	86.035,92	306,48	(94.822,58)
BRML3	416.172,35	29.619,10	10.573,38	0,16%	131.494,16	445,73	(129.600,13)
CASH3	39.299,13	6.616,31	4.303,52	0,06%	(4.770,87)	-	7.556,77
CCRO3	730.168,13	112.550,27	52.956,66	0,79%	(139.211,27)	(601,91)	243.163,80
CIEL3	315.140,64	49.518,73	38.028,29	0,57%	73.969,21	259,15	(78.508,89)
CMIG4	834.951,40	117.016,17	84.997,62	1,27%	(61.860,51)	(250,54)	92.070,64
CMIN3	184.705,08	18.479,02	15.679,67	0,24%	(5.790,88)	-	8.170,79
COGN3	295.263,00	30.114,92	8.223,67	0,12%	80.557,62	277,84	(82.529,91)
CPFE3	330.624,75	29.870,04	14.493,56	0,22%	(18.716,96)	(75,11)	27.247,41
CPLE6	582.145,80	61.350,05	27.830,29	0,42%	(1.422,03)	(5,55)	1.937,98
CRFB3	508.635,34	96.160,42	17.787,14	0,27%	(95.162,23)	(410,59)	165.352,52
CSAN3	976.053,56	165.762,86	115.159,29	1,73%	(194.689,80)	(846,22)	344.545,51
CSNA3	370.297,11	61.557,53	44.205,44	0,66%	40.438,55	149,66	(48.647,19)
CVCB3	92.102,82	14.633,57	8.868,63	0,13%	(12.485,56)	(52,29)	20.162,25
CYRE3	249.840,47	25.508,87	4.479,43	0,07%	109.208,99	353,47	(97.207,70)
DXCO3	131.470,08	20.246,18	10.208,47	0,15%	(26.794,59)	-	47.728,00
ECOR3	90.381,51	14.130,37	11.269,20	0,17%	(9.709,49)	(40,04)	15.093,68
EGIE3	511.216,86	23.765,06	11.851,38	0,18%	(28.045,30)	(112,44)	40.737,75
ELET3	3.575.623,32	377.783,42	250.184,52	3,75%	366.612,26	1.360,93	(444.162,86)
ELET6	729.942,48	81.266,98	48.173,17	0,72%	104.133,92	379,61	(120.987,73)
EMBR3	492.046,75	89.585,37	59.413,57	0,89%	(62.422,28)	(260,17)	99.609,01
ENBR3	283.549,68	20.713,40	11.914,79	0,18%	(2.223,35)	(8,70)	3.049,50
ENEV3	1.086.180,48	148.776,19	34.444,82	0,52%	(264.938,87)	(1.183,38)	502.053,60
ENGI11	589.387,50	43.357,72	29.629,66	0,44%	42.990,04	161,79	(53.773,54)
EQTL3	1.604.366,88	170.553,07	25.917,24	0,39%	590.339,53	1.960,97	(556.286,52)
EZTC3	99.209,67	12.463,05	3.101,32	0,05%	24.633,28	85,82	(25.814,32)
FLRY3	283.866,52	24.215,15	(140,45)	0,00%	75.282,24	260,45	(77.666,45)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	117.169.087,45	VAR / PL:	5,690%
VAR:	6.666.807,45	ETL / PL:	7,1354%
ETL:	8.360.448,37	VAR / CDI:	11203,23%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(2.463,37)	BAIXA 1:	3.040,70	Cenário 1:	17.139.238,34
				Cenário 2:	58.136,24
				Cenário 3:	(15.999.080,51)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
GGBR4	1.452.547,98	138.924,98	56.262,27	0,84%	369.731,04	1.284,76	(385.214,44)
GOAU4	389.483,22	32.610,66	11.721,67	0,18%	111.012,67	380,98	(112.477,54)
GOLL4	85.651,00	17.431,70	12.574,04	0,19%	(6.374,88)	(25,82)	9.492,24
HAPV3	1.633.762,13	378.068,93	120.167,74	1,80%	(161.485,70)	(662,77)	248.197,61
HYPE3	998.329,35	56.906,97	22.863,92	0,34%	228.445,67	802,34	(243.820,21)
IGTH1	191.820,20	15.093,94	8.742,49	0,13%	-	-	-
IRBR3	59.533,95	19.168,04	14.458,00	0,22%	(16.587,52)	(75,75)	33.257,44
ITSA4	2.512.400,80	145.530,14	97.647,81	1,46%	681.505,75	2.351,96	(699.197,80)
ITUB4	7.232.514,52	410.382,79	307.009,16	4,61%	1.722.195,20	6.025,20	(1.822.046,13)
JBSS3	1.493.137,84	150.279,34	85.611,12	1,28%	(295.405,28)	(1.282,74)	521.518,36
KLBN11	783.727,67	135.260,95	55.552,80	0,83%	190.447,49	664,94	(200.568,03)
LREN3	1.429.704,40	141.319,06	73.599,33	1,10%	402.921,97	1.384,58	(409.424,48)
LWSA3	216.904,74	50.313,45	43.186,00	0,65%	83.830,28	276,51	(77.774,69)
MGLU3	642.103,62	207.433,15	74.971,22	1,12%	95.811,84	348,26	(110.576,29)
MRFG3	177.833,52	37.858,18	24.687,89	0,37%	(40.387,75)	(178,52)	74.543,78
MRVE3	149.072,33	60.851,53	(3.426,82)	-0,05%	(41.399,18)	(188,96)	82.878,19
MULT3	336.801,60	22.567,15	17.427,39	0,26%	37.451,57	138,48	(44.959,23)
NTCO3	602.943,74	112.286,10	17.398,91	0,26%	(97.056,88)	(412,43)	162.400,25
PACUCAR_CBD ON ED	169.778,32	33.469,09	5.727,79	0,09%	(23.796,23)	(99,92)	38.671,93
PETR3	4.899.176,50	842.671,83	668.353,59	10,03%	1.027.696,60	3.638,59	(1.117.027,01)
PETR4	7.586.464,96	1.308.394,58	1.048.364,41	15,73%	1.704.445,03	5.996,76	(1.826.354,53)
PETZ3	143.448,84	32.915,57	5.939,43	0,09%	(32.345,03)	(142,83)	59.549,01
POS13	43.023,97	16.063,03	4.171,09	0,06%	(370,83)	(1,45)	509,09
PRI03	1.456.260,12	155.352,70	38.386,44	0,58%	649.361,16	2.095,00	(573.946,24)
QUAL3	106.168,87	14.855,24	9.472,37	0,14%	(24.494,54)	(108,51)	45.463,38
RADL3	1.515.463,56	89.465,31	60.263,24	0,90%	199.057,72	729,33	(233.982,84)
RAIL3	1.317.028,68	181.409,02	114.139,75	1,71%	65.758,89	250,20	(84.376,32)
RAIZ4	263.894,35	35.019,57	30.449,51	0,46%	(16.697,60)	-	24.512,53
RDOR3	1.445.307,20	281.819,73	134.143,00	2,01%	(297.811,90)	-	532.274,38
RENT3	3.046.408,62	223.523,52	192.357,93	2,89%	617.362,47	2.192,43	(675.658,63)
RRRP3	445.503,25	72.223,69	22.980,94	0,34%	199.223,31	642,45	(175.906,87)
SANB11	526.060,00	33.617,19	14.401,76	0,22%	39.876,60	149,88	(49.723,32)
SBSP3	1.032.602,22	183.492,09	59.923,21	0,90%	609.589,29	1.869,44	(482.899,99)
SLCE3	221.580,32	27.729,67	6.152,92	0,09%	(35.291,64)	(149,82)	58.909,47
SMT03	147.135,66	21.949,92	13.187,66	0,20%	(11.689,77)	(47,48)	17.518,69
SOMA3	346.206,39	52.362,05	30.549,50	0,46%	40.479,57	149,28	(48.302,45)
SULA11	326.704,40	61.633,31	29.425,78	0,44%	(67.501,51)	(294,66)	120.746,01
SUZB3	2.043.203,25	443.679,16	131.704,45	1,98%	705.353,84	2.363,67	(677.694,01)
TAE11	440.680,44	36.552,94	12.511,16	0,19%	(44.913,09)	(184,64)	69.310,37
TIMS3	540.643,29	45.916,82	1.515,85	0,02%	57.549,30	213,25	(69.433,72)
TOTS3	841.119,24	79.587,60	69.104,65	1,04%	153.607,94	550,22	(171.440,29)
UGPA3	720.854,07	96.158,32	70.969,77	1,06%	(25.346,88)	(100,59)	35.930,79
USIM5	193.121,25	23.171,41	17.955,01	0,27%	(11.646,52)	(46,83)	17.033,50
VALE3	15.644.622,80	1.804.343,45	146.922,86	2,20%	3.877.442,12	13.510,78	(4.065.051,39)
VBBR3	998.198,20	97.133,50	62.853,36	0,94%	(7.053,05)	-	9.684,90



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	117.169.087,45	VAR / PL:	5,690%
VAR:	6.666.807,45	ETL / PL:	7,1354%
ETL:	8.360.448,37	VAR / CDI:	11203,23%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(2.463,37)	BAIXA 1:	3.040,70	Cenário 1:	17.139.238,34
				Cenário 2:	58.136,24
				Cenário 3:	(15.999.080,51)

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
VIIA3	244.504,16	60.913,93	30.817,64	0,46%	48.563,13	-	(53.357,55)
VIVT3	900.555,66	42.873,35	12.097,31	0,18%	(60.950,85)	(246,02)	89.978,64
WEGE3	2.907.370,25	367.752,60	115.199,91	1,73%	1.255.502,10	4.071,56	(1.122.289,56)
YDUQ3	230.968,80	49.117,37	5.729,17	0,09%	78.253,42	262,89	(75.602,36)
INDZ22	-	281.584,44	281.221,27	4,22%	-	-	-
COMPROMISSADA	4.480.534,87	45,14	(19,66)	0,00%	353,51	(182,71)	(540,07)
EMP AÇÃO PROVISÃO	16.385,21	13,87	6,83	0,00%	86,36	(35,76)	(93,93)
LFT	988.445,56	113,46	8,17	0,00%	-	(0,00)	(0,00)
Total	115.688.365,00	13.550.958,84	6.666.807,45	100,00%	17.139.238,34	58.136,24	(15.999.080,51)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/10/2022

FIM EMB V A INVEST NO EXT CNPJ - 41252756000105

Dados Gerais

PL:	38.490.973,44	VAR / PL:	5,880%
VAR:	2.263.176,59	ETL / PL:	7,3735%
ETL:	2.838.115,73	VAR / CDI:	11577,06%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	5.663.303,37	BAIXA 1:	(4.640.704,99)	Cenário 1:	(1.485.764,81)
				Cenário 2:	(384.170,64)
				Cenário 3:	2.198.171,93

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	49.918,76	-	-	0,00%	-	-	-
CONTAS A PAGAR / RECEBER	(12.468,06)	-	-	0,00%	-	-	-
SPY	9.329.255,93	867.098,05	829.108,23	36,63%	(578.135,01)	(86.317,21)	847.321,33
URTH_US	3.269.316,52	123.090,97	(14.070,00)	-0,62%	4.386,72	(29.423,85)	(5.951,68)
VTV_US	5.913.438,49	556.894,79	520.929,66	23,02%	(80.539,95)	(53.220,95)	111.230,99
COMPROMISSADA	228.049,75	2,28	(0,24)	0,00%	17,99	(9,30)	(27,49)
LFT	12.310,44	5,77	1,93	0,00%	-	-	(0,00)
AB AMERICAN GROWTH	4.582.795,18	428.340,34	406.505,44	17,96%	(272.973,24)	(41.245,16)	398.861,61
FUNDSMITH EQ FUND	5.465.968,21	455.690,84	408.335,45	18,04%	(501.966,66)	(49.193,71)	764.445,70
LOOMIS US GROWTH	4.945.519,07	186.200,62	(21.283,79)	-0,94%	6.635,82	(44.509,67)	(9.003,16)
MFS MERIDIAN EUROPEA	1.658.905,85	179.919,19	164.885,16	7,29%	(72.928,94)	(14.930,15)	104.507,30
WELLINGTON GLO QUAL	7.257.849,32	273.260,70	(31.235,25)	-1,38%	9.738,46	(65.320,64)	(13.212,68)
Total	42.700.859,47	3.070.503,53	2.263.176,59	100,00%	(1.485.764,81)	(384.170,64)	2.198.171,93



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

31/10/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.JSIN	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB II	20/10/14	15/01/23	SABESP	821.442,60	BRSSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	21/10/14	15/01/23	SABESP	4.106.269,37	BRSSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	24/02/15	15/01/23	SABESP	2.129.184,41	BRSSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/05/15	15/04/23	RD COLIN	591.999,03	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	591.789,99	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	651.024,13	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/06/15	15/04/23	RD COLIN	763.460,96	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	12/08/15	16/07/23	DUKE GEP	1.436.126,17	BRGEPADBS079	-	Aaa.br	-
FI RF EMB II	06/11/15	04/11/22	BRADESCO	8.009.776,60	BRBBDCLFR744	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	18/11/15	16/11/22	BRADESCO	19.838.653,54	BRBBDCLFR8X2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/01/23	ECPT	18.139,78	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	11/02/16	15/01/23	ECPT	62.980,72	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/01/23	ECPT	302.844,91	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/24	TRANS AL	1.165.218,31	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	430.204,38	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	258.122,63	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/24	TRANS AL	859.326,34	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	158.411,82	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	101.888,49	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	10/10/16	15/01/23	SABESP	163.783,18	BRSSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/01/23	ECPT	146.203,15	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/01/23	ECPT	275.346,24	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/17	15/04/23	RD COLIN	1.401.867,79	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	25/08/17	15/08/24	PETR	17.328.072,45	BRPETRDBS084	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/11/27	RB CAPIT	3.748.967,53	BRBRACR14G2	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/11/27	RB CAPIT	1.094.203,22	BRBRACR14G2	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/11/27	RB CAPIT	3.898.769,35	BRBRACR14G2	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.251.851,07	BRSSPDBS1A7	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.741.784,27	BRSSPDBS1A7	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.624.530,87	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	15/05/28	COMGAS	27.617.701,92	BRGASDBS093	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	621.246,60	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	621.246,60	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	621.246,60	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	619.866,74	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	621.246,60	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	11.758.997,06	BRERDVBS0E8	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	13.555.341,45	BRAEGPDBS038	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	15/07/25	CSMG	15.194.811,71	BRCSMGDBS0E7	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	438.792,10	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	249.044,16	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	658.188,14	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/25	CEMIG	1.933.622,91	BRMGDBS041	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB II A	14/11/18	15/03/24	BRADESCO	324.574,83	BRBBDCLTR6K7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	04/01/19	07/06/24	MOV_PART	814.760,96	BRMOVIDBS085	-	-	AA-(bra)
FIM EMB II A	17/01/19	16/09/24	ITAUBB	298.272,32	BRBITALFIU67	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	15/01/25	ITAUBB	2.711.625,40	BRBITALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	12/02/19	15/01/25	ITAUBB	2.711.625,40	BRBITALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	542.056,65	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	3.432.156,82	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	1.954.531,22	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	5.909.199,39	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	675.650,36	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	5.466.625,69	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	8.107.804,39	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	835.349,54	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	592.874,46	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	22/09/25	BCBF	258.752,68	BRBCFBDBS032	-	-	AA+(bra)



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 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 referido estudo.

6. RISCO LEGAL

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

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Bradesco

Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação		4.193.763.238,02			
Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.186.021.091,30	4.193.763.238,02	75,97%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	2.379.692.776,59	4.193.763.238,02	56,74%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	806.328.314,71	3.355.010.640,41	19,23%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	838.752.660,10	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	419.376.330,05	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.048.440.809,51	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.048.440.809,51	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	578.520.245,99	2.935.634.216,62	13,79%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.048.440.809,51	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	110.807.077,71	838.752.660,10	2,64%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	29.089.540,61	629.064.510,70	0,69%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	838.752.660,10	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	65.038.949,41	419.376.330,05	1,55%	Enquadrado

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



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.



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.