

Plano de Contribuição Definida - PCD

out/2020

Recursos Garantidores (R\$ milhões) 202,8

Alocação por segmento

Descrição	Carteira	Valor (R\$ milhões)	RG	Política de Investimentos - PI			Resolução CMN nº 4.661		Status
				Mín.	Alvo	Máx.	Patamar	Referência	
Renda Fixa	Própria e Terceirizada	120,5	59,4	30,0	49,8	100,0	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	34,1	16,8	-	25,0	40,0	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	27,4	13,5	-	15,0	20,0	20	Art. 23	✓
Operações com Participantes	Própria	0,4	0,2	-	0,2	5,0	15	Art. 25	✓
Exterior ¹	Própria	20,3	10,03	-	10,0	10,0	10	Art. 26	!
Outros ²	///////	0,03	0,01	-	-	-	-	-	-

¹ Verificado desenquadramento passivo como alerta na exposição no segmento exterior e no ativo IVVB11, sendo a conformidade respaldada pela previsão legal de adequação em até dois anos e pela observância à vedação de realizar investimentos que agravem a situação, consoante estabelecido nos § 1º e 2º do art. 35. da resolução acima.

² Disponível, proventos, valores a receber e a pagar e outros realizáveis.

Alocação por emissor

Descrição	Carteira	Valor (R\$ milhões)	RG	PI	Res. CMN nº 4.661		Status
					Patamar	Referência Art. 27	
Tesouro Nacional	Própria e Terceirizada	66,5	32,8	100,0	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				20,0	20	Inciso II	✓
Itaú	Própria e Terceirizada	0,6	0,3				
Demais Emissores - Maior exposição				10,0	10	Inciso III	!
Ishares S&P 500	Própria	20,3	10,03				

Fonte: Nota Secoi-2020/41, de 12 de novembro.