

Enquadramento dos Investimentos

Tendo por referência as disposições da Política de Investimentos - PI, bem como da Resolução CMN nº 4.661, de 25 de maio de 2018, evidencia-se, a seguir, o enquadramento atinente à alocação dos recursos do PBB, com base no saldo contábil dos Recursos Garantidores - RG de agosto de 2021, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 5.642.8 milhões

Alocação por segmento

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ milhões)	RG	Política de Investimentos - PI			Resolução CMN nº 4.661		Status
				Mín.	Alvo	Máx.	Patamar	Referência	
Renda Fixa	Própria e Terceirizada	4.457,5	79,0	60,0	82,5	100,0	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	97,1	1,7	-	2,0	10,0	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	709,2	12,6	-	10,0	15,0	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Própria e Terceirizada	81,5	1,4	-	2,9	5,0	20	Art. 24 ¹	✓
Operações com Participantes	Própria	10,9	0,2	-	0,2	5,0	15	Art. 25	✓
Exterior	Própria	284,7	5,0	-	2,4	10,0	10	Art. 26	✓
Outros ²	////////////////////	1,9	0,03	-	-	-	-	-	-

¹ § 4º do art. 37.

² Disponível, proventos, valores a receber e a pagar, provisão de investimentos e depósito judicial.

Observação: Retificam-se os limites da PI apresentados nas Notas anteriores, tendo em vista que se referiam ao instrumento de 2020. Realça-se que os patamares de monitoramento diário mostravam-se condizentes, portanto, não houve agravo à aferição da conformidade do enquadramento.

Alocação por emissor

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ milhões)	RG	PI	Res. CMN nº 4.661		Status
					Patamar	Referência Art. 27	
Tesouro Nacional	Própria e Terceirizada	4.442,8	78,7	100,0	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5,0	20	Inciso II	✓
Itaú	Própria e Terceirizada	2,0	0,03				
Demais Emissores - Maior exposição				10,0	10	Inciso III	✓
Ishares S&P 500	Própria	284,7	5,0				

Fonte: Nota Geris-2021/278, de 21 de setembro.