

Enquadramento dos Investimentos

Tendo por referência as disposições da Política de Investimentos - PI, bem como da Resolução CMN nº 4.994, de 24 de março de 2022, evidencia-se, a seguir, o enquadramento atinente à alocação dos recursos do PBB, com base no saldo contábil dos Recursos Garantidores - RG de setembro de 2024, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 5.097,8 milhões

Alocação por segmento

Descrição	Gestão	Valor (R\$ milhões)	RG	Política de Investimentos - PI			Resolução CMN nº 4.994		Status
				Mín.	Alvo	Máx.	Patamar	Referência	
Renda Fixa	Própria e Terceirizada	4.187,8	82,1	40	78,4	100	100	Art. 21	✓
Renda Fixa - Vedações	Terceirizada	0,01	0,0001	-	-	-	-	Art. 36	!
Renda Variável	Própria e Terceirizada	91,5	1,8	-	2,5	20	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	318,8	6,3	-	4,8	20	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Própria	98,3	1,9	-	1,2	20	20	Art. 24 ¹	✓
Operações com Participantes	Própria	10,6	0,2	-	0,2	5	15	Art. 25	✓
Exterior	Terceirizada	335,8	6,6	-	4,3	10	10	Art. 26	✓
Outros ²	Própria e Terceirizada	55,0	1,1	n/a	8,6	n/a	n/a	///////	-

¹ § 4º do art. 37.

² Saldo de OFND (Precatórios), imóveis em processo de desapropriação, disponível, proventos, valores a receber e a pagar e opções de futuros, inclusive do FIRFCP (até 5º nível) e FICFIM.

! A Centrus esclarece que o status em atenção decorreu da exposição, indireta, em três emissões de debêntures, sem incentivo no âmbito da Lei nº 12.431/2011, de empresas de capital fechado. Não obstante a ínfima representatividade, à luz do regramento, configurou-se inobservância. Acrescenta-se que, a partir da posição de outubro do corrente, a posição está reenquadrada.

Alocação por emissor

Descrição	Gestão	Valor (R\$ milhões)	RG	PI	Res. CMN nº 4.994		Status
					Patamar	Referência Art. 27	
Tesouro Nacional	Própria e Terceirizada	4.167,6	81,8	100	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5	20	Inciso II	✓
Bradesco	Própria e Terceirizada	1,1	0,02				
Demais Emissores - Maior exposição				10	10	Inciso III	✓
Centrus Scutum FIME	Terceirizada ¹	180,3	3,5				

¹ Fundo exclusivo.

Fonte: Nota Geris-2024/374, de 25 de outubro.