

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 PCD, com base no saldo contábil dos Recursos Garantidores - RG de julho de 2024, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 265,0 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	182,7	69,0	25	64,9	100	100	Art. 21	!
Renda Variável	Própria e Terceirizada	27,1	10,2	-	9,9	50	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	15,3	5,8	-	6,3	20	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	16,0	6,0	-	8,8	20	20	Art. 24	✓
Operações com Participantes	Própria	1,2	0,4	-	0,3	5	15	Art. 25	✓
Exterior	Terceirizada	22,6	8,5	-	9,8	10	10	Art. 26	✓
Outros ¹	Própria e Terceirizada	0,1	0,02	-	-	-	-	-	-

¹ Outros realizáveis, disponível, proventos, valores a receber e a pagar e opções de futuros, inclusive do FIRFCP (até 3º nível) e FICFIM.

! A Centrus esclarece que o status em atenção decorreu da exposição, indireta, em uma emissão de debênture, sem incentivo no âmbito da Lei nº 12.431/2011, de empresa de capital fechado. A participação equivaleu a 0,001% dos RG do Plano. 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	126,5	47,7	100	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5	20	Inciso II	✓
Banco do Brasil	Própria e Terceirizada	0,4	0,1				
Demais Emissores - Maior exposição				10	10	Inciso III	✓
It Now Ima-B	Própria	25,0	9,4				

Fonte: Notas Geris-2024/282 e 348, de 20 de agosto e 7 de outubro, respectivamente.