

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 setembro de 2024, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 264,3 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	181,5	68,7	25	64,9	100	100	Art. 21	✓
Renda Fixa - Vedações	Terceirizada	0,002	0,001	-	-	-	-	Art. 36	!
Renda Variável	Própria e Terceirizada	28,1	10,6	-	9,9	50	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	15,5	5,9	-	6,3	20	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	15,3	5,8	-	8,8	20	20	Art. 24	✓
Operações com Participantes	Própria	1,2	0,4	-	0,3	5	15	Art. 25	✓
Exterior	Terceirizada	22,5	8,5	-	9,8	10	10	Art. 26	✓
Outros ¹	Própria e Terceirizada	0,2	0,1	-	-	-	-	-	-

¹ Outros realizáveis, 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	124,9	47,3	100	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição Bradesco	Própria e Terceirizada	0,4	0,1	5	20	Inciso II	✓
Demais Emissores - Maior exposição It Now Ima-B	Própria	24,9	9,4	10	10	Inciso III	✓

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