

Plano Básico de Benefícios - PBB

mai/2020

Recursos Garantidores (R\$ milhões) 5.854,1

Alocação por segmento

| Descrição | Carteira | Valor (R\$ milhões) | RG | Política de Investimentos - PI | | | Resolução CMN nº 4.661 | | Status |
|-----------------------------|------------------------|------------------------|-------|--------------------------------|------|-------|------------------------|----------------------|--------|
| | | | | Min. | Alvo | Máx. | Patamar | Referência | |
| Renda Fixa | Própria e Terceirizada | 5.239,3 | 89,5 | 60,0 | 85,1 | 100,0 | 100 | Art. 21 | ✓ |
| Renda Variável | Própria | 187,0 | 3,2 | - | 4,0 | 10,0 | 70 | Art. 22 | ✓ |
| Estruturado | Terceirizada | 335,7 | 5,7 | - | 7,3 | 15,0 | 20 | Art. 23 | ✓ |
| Imobiliário | Própria | 77,0 | 1,3 | - | 1,3 | 5,0 | 20 | Art. 24 ¹ | ✓ |
| Operações com Participantes | Própria | 15,0 | 0,3 | - | 0,3 | 5,0 | 15 | Art. 25 | ✓ |
| Outros ² | //////////////////// | 0,1 | 0,002 | - | - | - | - | - | - |

¹ § 4º do art. 37.

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

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 | 5.239,3 | 89,5 | 100,0 | 100 | Inciso I | ✓ |
| Instituições Financeiras - Maior exposição | | | | 5,0 | 20 | Inciso II | ✓ |
| Itaú | Própria | 4,9 | 0,1 | | | | |
| Demais Emissores - Maior exposição | | | | 10,0 | 10 | Inciso III | ✓ |
| SPX Nimitz Estruturado FICFIM | Terceirizada | 74,8 | 1,3 | | | | |

Fonte: Nota Secoi-2020/22, de 17 de junho.