

Plano de Contribuição Definida - PCD

mar/2020

Recursos Garantidores (R\$ milhões) 181,0

Alocação por segmento

Descrição	Carteira	Valor (R\$ milhões)	RG	Política de Investimentos - PI			Resolução CMN nº 4.661		Status
				Mín.	Alvo	Máx.	Patamar	Referência	
Renda Fixa	Própria e Terceirizada	103,2	57,0	30,0	49,8	100,0	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	31,3	17,3	-	25,0	40,0	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	26,5	14,6	-	15,0	20,0	20	Art. 23	✓
Operações com Participantes	Própria	0,2	0,1	-	0,2	5,0	15	Art. 25	✓
Exterior ¹	Própria	19,6	10,8	-	10,0	10,0	10	Art. 26	!
Outros ²	////////////////////	0,2	0,1	-	-	-	-	-	-

¹ Verificado desenquadramento passivo como alerta na exposição no segmento exterior e no ativo IVVB11, sendo a conformidade respaldada pela previsão legal de adequação em até dois anos e pela observância à vedação de realizar investimentos que agravem a situação, consoante estabelecido nos § 1º e 2º do art. 35. da resolução acima.

² Disponível, proventos, valores a receber e a pagar e outros realizáveis.

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	65,9	36,4	100,0	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				20,0	20	Inciso II	✓
Itaú	Própria e Terceirizada	1,4	0,8				
Demais Emissores - Maior exposição				10,0	10	Inciso III	!
Ishares S&P 500	Própria	19,6	10,8				

Fonte: Nota Secoi-2020/15, de 15 de abril.