

## Plano Básico de Benefícios - PBB

out/2020

**Recursos Garantidores (R\$ milhões) 5.804,5**

### Alocação por segmento

| Descrição                   | Carteira               | Valor<br>(R\$ milhões) | RG   | Política de Investimentos - PI |      |       | Resolução CMN nº 4.661 |                      | Status |
|-----------------------------|------------------------|------------------------|------|--------------------------------|------|-------|------------------------|----------------------|--------|
|                             |                        |                        |      | Min.                           | Alvo | Máx.  | Patamar                | Referência           |        |
| Renda Fixa                  | Própria e Terceirizada | 5.078,4                | 87,5 | 60,0                           | 85,1 | 100,0 | 100                    | Art. 21              | ✓      |
| Renda Variável              | Própria                | 219,0                  | 3,8  | -                              | 4,0  | 10,0  | 70                     | Art. 22              | ✓      |
| Estruturado                 | Terceirizada           | 410,9                  | 7,1  | -                              | 7,3  | 15,0  | 20                     | Art. 23              | ✓      |
| Imobiliário                 | Própria                | 81,1                   | 1,4  | -                              | 1,3  | 5,0   | 20                     | Art. 24 <sup>1</sup> | ✓      |
| Operações com Participantes | Própria                | 12,4                   | 0,2  | -                              | 0,3  | 5,0   | 15                     | Art. 25              | ✓      |
| Outros <sup>2</sup>         | ////////////////////   | 2,7                    | 0,05 | -                              | -    | -     | -                      | -                    | -      |

<sup>1</sup> § 4º do art. 37.

<sup>2</sup> Disponível, proventos, valores a receber e a pagar e depósito judicial.

### Alocação por emissor

| Descrição                                  | Carteira               | Valor<br>(R\$ milhões) | RG   | PI    | Res. CMN nº 4.661 |                    | Status |
|--------------------------------------------|------------------------|------------------------|------|-------|-------------------|--------------------|--------|
|                                            |                        |                        |      |       | Patamar           | Referência Art. 27 |        |
| Tesouro Nacional                           | Própria e Terceirizada | 4.957,1                | 85,4 | 100,0 | 100               | Inciso I           | ✓      |
| Instituições Financeiras - Maior exposição |                        |                        |      | 5,0   | 20                | Inciso II          | ✓      |
| Itaú                                       | Própria e Terceirizada | 3,1                    | 0,1  |       |                   |                    |        |
| Demais Emissores - Maior exposição         |                        |                        |      | 10,0  | 10                | Inciso III         | ✓      |
| Ishares Ibovespa                           | Própria                | 120,5                  | 2,1  |       |                   |                    |        |

Fonte: Nota Secoi-2020/41, de 12 de novembro.