

Enquadramento dos Investimentos

Tendo por referência as disposições da Política de Investimentos - PI, bem como da Resolução CMN nº 4.661, de 25 de maio de 2018, evidencia-se, a seguir, o enquadramento atinente à alocação dos recursos do PBB, com base no saldo contábil dos Recursos Garantidores - RG de setembro de 2021, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 5.670,3 milhões

Alocação por segmento

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ milhões)	RG	Política de Investimentos - PI			Resolução CMN nº 4.661		Status
				Mín.	Alvo	Máx.	Patamar	Referência	
Renda Fixa	Própria e Terceirizada	4.476,2	78,9	60,0	82,5	100,0	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	91,2	1,6	-	2,0	10,0	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	717,1	12,6	-	10,0	15,0	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Própria e Terceirizada	86,9	1,5	-	2,9	5,0	20	Art. 24 ¹	✓
Operações com Participantes	Própria	11,0	0,2	-	0,2	5,0	15	Art. 25	✓
Exterior	Própria	285,8	5,0	-	2,4	10,0	10	Art. 26	✓
Outros ²	////////////////////	2,0	0,04	-	-	-	-	-	-

¹ § 4º do art. 37.

² Disponível, proventos, valores a receber e a pagar, opções DI, provisão de investimentos e depósito judicial.

Alocação por emissor

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ milhões)	RG	PI	Res. CMN nº 4.661		Status
					Patamar	Referência Art. 27	
Tesouro Nacional	Própria e Terceirizada	4.461,9	78,7	100,0	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5,0	20	Inciso II	✓
Itaú	Própria e Terceirizada	1,8	0,03				
Demais Emissores - Maior exposição				10,0	10	Inciso III	✓
Ishares S&P 500	Própria	285,8	5,0				

Fonte: Nota Geris-2021/304, de 18 de outubro.