

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 PBDC, com base no saldo contábil dos Recursos Garantidores - RG de outubro de 2021, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 584,1 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	413,4	70,8	60,0	74,1	100,0	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	18,3	3,1	-	3,0	15,0	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	83,5	14,3	-	14,9	20,0	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Própria e Terceirizada	17,0	2,9	-	3,4	6,5	20	Art. 24 ¹	✓
Operações com Participantes	Própria	2,3	0,4	-	0,5	5,0	15	Art. 25	✓
Exterior	Própria	49,4	8,5	-	4,1	10,0	10	Art. 26	✓
Outros ²	////////////////////////////////////	0,1	0,01	-	-	-	-	-	-

¹ § 4º do art. 37.

² Disponível, proventos, valores a receber e a pagar 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	367,5	62,9	100,0	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5,0	20	Inciso II	✓
Itaú	Própria	0,2	0,03				
Demais Emissores - Maior exposição				10,0	10	Inciso III	✓
Ishares S&P 500	Própria	49,4	8,5				

Fonte: Nota Geris-2021/345, de 12 de novembro.