

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 PCD, com base no saldo contábil dos Recursos Garantidores - RG de janeiro de 2022, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 221,6 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	88,3	39,9	25,0	39,2	100,0	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	60,0	27,1	-	28,1	50,0	70	Art. 22	✓
Estruturado ¹	Terceirizada	34,0	15,3	-	10,0	15,0	15	Art. 23	!
Imobiliário	Terceirizada	19,4	8,8	-	12,5	20,0	20	Art. 24	✓
Operações com Participantes	Própria	0,4	0,2	-	0,2	5,0	15	Art. 25	✓
Exterior	Própria e Terceirizada	19,5	8,8	-	10,0	10,0	10	Art. 26	✓
Outros ²	Própria	0,02	0,01	-	-	-	-	-	-

¹ Verificado desenquadramento passivo como alerta na exposição no segmento estruturado, 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 CMN nº 4.661, de 2018.

² Disponível e outros realizáveis.

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	38,5	17,4	100,0	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5,0	20	Inciso II	✓
Itaú	Própria e Terceirizada	1,0	0,5				
Demais Emissores - Maior exposição				10,0	10	Inciso III	✓
Ishares Ibovespa	Própria	20,3	9,2				

Fonte: Nota Geris-2022/48, de 21 de fevereiro.