

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 abril de 2022, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 227,5 milhões

Alocação por segmento

%

| Descrição | Gestão | Valor (R\$ milhões) | RG | Política de Investimentos - PI | | | Resolução CMN nº 4.661 | | Status |
|-----------------------------|------------------------|------------------------|------|--------------------------------|------|-------|------------------------|------------|--------|
| | | | | Min. | Alvo | Máx. | Patamar | Referência | |
| Renda Fixa | Própria e Terceirizada | 129,8 | 57,1 | 25,0 | 39,2 | 100,0 | 100 | Art. 21 | ✓ |
| Renda Variável | Própria | 33,2 | 14,6 | - | 28,1 | 50,0 | 70 | Art. 22 | ✓ |
| Estruturado | Terceirizada | 25,7 | 11,3 | - | 10,0 | 15,0 | 15 | Art. 23 | ✓ |
| Imobiliário | Terceirizada | 18,9 | 8,3 | - | 12,5 | 20,0 | 20 | Art. 24 | ✓ |
| Operações com Participantes | Própria | 0,4 | 0,2 | - | 0,2 | 5,0 | 15 | Art. 25 | ✓ |
| Exterior | Terceirizada | 18,1 | 8,0 | - | 10,0 | 10,0 | 10 | Art. 26 | ✓ |
| Outros ¹ | Própria | 1,4 | 0,6 | - | - | - | - | - | - |

¹ 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 | 77,1 | 33,9 | 100,0 | 100 | Inciso I | ✓ |
| Instituições Financeiras - Maior exposição | | | | 5,0 | 20 | Inciso II | ✓ |
| Itaú | Própria e Terceirizada | 0,8 | 0,4 | | | | |
| Demais Emissores - Maior exposição | | | | 10,0 | 10 | Inciso III | ✓ |
| It Now Ima-B | Própria | 20,9 | 9,2 | | | | |

Fonte: Nota Geris-2022/134, de 16 de maio.