

Enquadramento dos Investimentos

Tendo por referência as disposições da Política de Investimentos - PI, bem como da Resolução CMN nº 4.994, de 24 de março de 2022, evidencia-se, a seguir, o enquadramento atinente à alocação dos recursos do PCD, com base no saldo contábil dos Recursos Garantidores - RG de setembro de 2022, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 234,1 milhões

Alocação por segmento

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ milhões)	RG	Política de Investimentos - PI			Resolução CMN nº 4.994		Status
				Min.	Alvo	Máx.	Patamar	Referência	
Renda Fixa	Própria e Terceirizada	140,8	60,2	25	39,2	100	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	29,0	12,4	-	28,1	50	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	25,8	11,0	-	10,0	20	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	19,8	8,4	-	12,5	20	20	Art. 24	✓
Operações com Participantes	Própria	0,4	0,2	-	0,2	5	15	Art. 25	✓
Exterior	Terceirizada	18,3	7,8	-	10,0	10	10	Art. 26	✓
Outros ¹	Própria	0,02	0,01	-	-	-	-	-	-

¹ Disponível e outros realizáveis.

Alocação por emissor

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ milhões)	RG	PI	Res. CMN nº 4.994		Status
					Patamar	Referência Art. 27	
Tesouro Nacional	Própria e Terceirizada	86,8	37,1	100	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5	20	Inciso II	✓
Itaú	Própria e Terceirizada	0,9	0,4				
Demais Emissores - Maior exposição				10	10	Inciso III	✓
It Now Ima-B5+	Própria	21,5	9,2				

Fonte: Nota Geris-2022/299, de 18 de outubro.