

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 2023, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 252,1 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	160,7	63,7	25	65,2	100	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	31,0	12,3	-	10,7	50	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	20,8	8,3	-	8,3	20	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	20,2	8,0	-	7,9	20	20	Art. 24	✓
Operações com Participantes	Própria	0,8	0,3	-	0,2	5	15	Art. 25	✓
Exterior	Terceirizada	18,4	7,3	-	7,7	10	10	Art. 26	✓
Outros ¹	Própria e Terceirizada	0,06	0,02	-	-	-	-	-	-

¹ Outros realizáveis, disponível, opções DI e valores a receber e a pagar, inclusive do FIRFCP e FICFIM.

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	99,5	39,5	100	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5	20	Inciso II	✓
Bradesco	Própria e Terceirizada	0,9	0,4				
Demais Emissores - Maior exposição				10	10	Inciso III	✓
It Now Ima-B	Própria	23,7	9,4				

Fonte: Nota Geris-2023/308, de 11 de outubro.