

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 fevereiro de 2024, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 262,5 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 | 183,6 | 70,0 | 25 | 64,9 | 100 | 100 | Art. 21 | ✓ |
| Renda Variável | Própria | 27,0 | 10,3 | - | 9,9 | 50 | 70 | Art. 22 | ✓ |
| Estruturado | Terceirizada | 12,7 | 4,8 | - | 6,3 | 20 | 20 | Art. 23 | ✓ |
| Imobiliário | Terceirizada | 17,4 | 6,6 | - | 8,8 | 20 | 20 | Art. 24 | ✓ |
| Operações com Participantes | Própria | 1,1 | 0,4 | - | 0,3 | 5 | 15 | Art. 25 | ✓ |
| Exterior | Terceirizada | 19,4 | 7,4 | - | 9,8 | 10 | 10 | Art. 26 | ✓ |
| Outros ¹ | Própria e Terceirizada | 1,2 | 0,5 | - | - | - | - | - | - |

¹ Outros realizáveis, disponível, proventos, valores a receber e a pagar e opções de futuros, 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 | 121,0 | 46,1 | 100 | 100 | Inciso I | ✓ |
| Instituições Financeiras - Maior exposição | | | | 5 | 20 | Inciso II | ✓ |
| Bradesco | Própria e Terceirizada | 0,8 | 0,3 | | | | |
| Demais Emissores - Maior exposição | | | | 10 | 10 | Inciso III | ✓ |
| It Now Ima-B5+ | Própria | 24,8 | 9,5 | | | | |

Fonte: Nota Geris-2024/82, de 13 de março.