

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 CP+, com base no saldo contábil dos Recursos Garantidores - RG de maio de 2024, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 29,1 milhões

Alocação por segmento

Descrição	Gestão	Valor (R\$ mil)	RG	Política de Investimentos - PI			Resolução CMN nº 4.994		Status
				Mín.	Alvo	Máx.	Patamar	Referência	
Renda Fixa	Própria e Terceirizada	22.472,8	77,3	25	65,9	100	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	2.287,7	7,9	-	8,9	50	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	1.589,6	5,5	-	6,5	20	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	1.073,0	3,7	-	8,7	20	20	Art. 24	✓
Exterior	Terceirizada	1.643,4	5,7	-	10,0	10	10	Art. 26	✓
Outros ¹	Própria e Terceirizada	2,0	0,01	-	-	-	-	-	-

¹ Disponível e valores a receber e a pagar, inclusive do FICFIM.

Alocação por emissor

Descrição	Gestão	Valor (R\$ mil)	RG	PI	Res. CMN nº 4.994		Status
					Patamar	Referência Art. 27	
Tesouro Nacional	Própria e Terceirizada	18.495,9	63,6	100	100	Inciso I	✓
Demais Emissores - Maior exposição				10	10	Inciso III	✓
Brad Ima-B5m	Própria	1.180,8	4,1				

Fonte: Nota Geris-2024/185, de 14 de junho.