

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 CP+, com base no saldo contábil dos Recursos Garantidores - RG de agosto de 2021, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 7,9 milhões

Alocação por segmento

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ mil)	RG	Política de Investimentos - PI			Resolução CMN nº 4.661		Status
				Mín.	Alvo	Máx.	Patamar	Referência	
Renda Fixa	Tercerizada	3.746,1	47,6	30,0	50,2	100,0	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	1.460,5	18,6	-	15,0	40,0	70	Art. 22	✓
Estruturado	Tercerizada	1.169,3	14,9	-	14,9	15,0	15	Art. 23	✓
Imobiliário	Tercerizada	744,5	9,5	-	10,0	20,0	20	Art. 24	✓
Exterior	Própria	734,3	9,3	-	9,9	10,0	10	Art. 26	✓
Outros ¹	////////////////////	8,8	0,1	-	-	-	-	-	-

¹ Disponível e valores a receber e a pagar.

Observação: Retificam-se os limites da PI apresentados nas Notas anteriores, tendo em vista que se referiam ao instrumento de 2020. Realça-se que os patamares de monitoramento diário mostravam-se condizentes, portanto, não houve agravamento à aferição da conformidade do enquadramento.

Alocação por emissor

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ mil)	RG	PI	Res. CMN nº 4.661		Status
					Patamar	Referência Art. 27	
Tesouro Nacional	Terceirizada	300,4	3,8	100,0	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				20,0	20	Inciso II	✓
Safrá	Terceirizada	14,2	0,2				
Demais Emissores - Maior exposição				10,0	10	Inciso III	✓
Brad Ima-B	Própria	758,6	9,6				

Fonte: Nota Geris-2021/278, de 21 de setembro.