

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 setembro de 2021, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 8,9 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	Terceirizada	3.329,4	37,6	30,0	50,2	100,0	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	2.515,0	28,4	-	15,0	40,0	70	Art. 22	✓
Estruturado ¹	Terceirizada	1.340,3	15,1	-	14,9	15,0	15	Art. 23	!
Imobiliário	Terceirizada	853,7	9,6	-	10,0	20,0	20	Art. 24	✓
Exterior	Própria	822,1	9,3	-	9,9	10,0	10	Art. 26	✓
Outros ²	////////////////////	2,9	0,03	-	-	-	-	-	-

¹ Verificado desenquadramento passivo como alerta na exposição no segmento estruturado, sendo a conformidade respaldada pela previsão legal de adequação em até dois anos e pela observância à vedação de realizar investimentos que agravem a situação, consoante estabelecido nos § 1º e 2º do art. 35. da resolução acima.

² Disponível e valores a receber e a pagar.

Alocação por emissor

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ mil)	RG	PI	Res. CMN nº 4.661		Status
					Patamar	Referência Art. 27	
Tesouro Nacional	Terceirizada	360,8	4,1	100,0	100	Inciso I	✓
Demais Emissores - Maior exposição				10,0	10	Inciso III	✓
Brad Ima-B5m	Própria	853,6	9,6				

Fonte: Nota Geris-2021/304, de 18 de outubro.