

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

Recursos Garantidores

R\$ 9,6 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	3.592,0	37,6	30,0	50,2	100,0	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	2.692,4	28,2	-	15,0	40,0	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	1.400,5	14,7	-	14,9	15,0	15	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	916,0	9,6	-	10,0	20,0	20	Art. 24	✓
Exterior	Própria	947,2	9,9	-	9,9	10,0	10	Art. 26	✓
Outros ¹	////////////////////	3,4	0,04	-	-	-	-	-	-

¹ 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	553,2	5,8	100,0	100	Inciso I	✓
Demais Emissores - Maior exposição				10,0	10	Inciso III	✓
Ishares S&P 500	Própria	947,2	9,9				

Fonte: Nota Geris-2021/345, de 12 de novembro.