

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

Recursos Garantidores

R\$ 9,9 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	3.739,0	37,8	30,0	50,2	100,0	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	2.881,3	29,1	-	15,0	40,0	70	Art. 22	✓
Estruturado	Tercerizada	1.385,1	14,0	-	14,9	15,0	15	Art. 23	✓
Imobiliário	Tercerizada	931,6	9,4	-	10,0	20,0	20	Art. 24	✓
Exterior	Própria	939,0	9,5	-	9,9	10,0	10	Art. 26	✓
Outros ¹	////////////////////	17,9	0,2	-	-	-	-	-	-

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	436,3	4,4	100,0	100	Inciso I	✓
Demais Emissores - Maior exposição				10,0	10	Inciso III	!
Brad Ima-B5m ¹	Própria	993,2	10,04				

¹ Verificado desenquadramento passivo como alerta na exposição no ativo B5MB11, 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 CMN nº 4.661, de 2018.

Fonte: Nota Geris-2021/374, de 15 de dezembro.