

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

Recursos Garantidores

R\$ 11,0 milhões

Alocação por segmento

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ mil)	RG	Política de Investimentos - PI			Resolução CMN nº 4.661		Status
				Min.	Alvo	Máx.	Patamar	Referência	
Renda Fixa	Terceirizada	4.330,5	39,2	30,0	50,2	100,0	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	3.488,0	31,6	-	15,0	40,0	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	1.405,4	12,7	-	14,9	15,0	15	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	1.021,7	9,2	-	10,0	20,0	20	Art. 24	✓
Exterior	Própria	1.026,6	9,3	-	9,9	10,0	10	Art. 26	✓
Outros ¹	////////////////////	-226,5	-2,1	-	-	-	-	-	-

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	660,8	6,0	100,0	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				20,0	20	Inciso II	✓
Safrá	Terceirizada	19,8	0,2				
Demais Emissores - Maior exposição				10,0	10	Inciso III	✓
Ishares Ibovespa	Própria	1.034,5	9,4				

Fonte: Nota Geris-2022/17, de 17 de janeiro.