

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 março de 2022, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 12,8 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	Própria e Terceirizada	6.822,1	53,4	25,0	36,3	100,0	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	2.644,0	20,7	-	31,2	50,0	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	1.514,3	11,9	-	10,0	20,0	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	948,8	7,4	-	12,5	20,0	20	Art. 24	✓
Exterior	Terceirizada	843,6	6,6	-	10,0	10,0	10	Art. 26	✓
Outros ¹	Própria	6,0	0,05	-	-	-	-	-	-

¹ Disponível.

Alocação por emissor

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ mil)	RG	PI	Res. CMN nº 4.661		Status
					Patamar	Referência Art. 27	
Tesouro Nacional	Própria e Terceirizada	3.036,8	23,8	100,0	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5,0	20	Inciso II	✓
Itaú	Terceirizada	22,8	0,2				
Demais Emissores - Maior exposição				10,0	10	Inciso III	✓
Brad Ima-B5m	Própria	1.014,3	7,9				

Fonte: Nota Geris-2022/106, de 19 de abril.