

Enquadramento dos Investimentos

Tendo por referência as disposições da Política de Investimentos - PI, bem como da Resolução CMN nº 4.994, de 24 de março de 2022, evidencia-se, a seguir, o enquadramento atinente à alocação dos recursos do CP+, com base no saldo contábil dos Recursos Garantidores - RG de maio de 2022, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 13,5 milhões

Alocação por segmento

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ mil)	RG	Política de Investimentos - PI			Resolução CMN nº 4.994		Status
				Mín.	Alvo	Máx.	Patamar	Referência	
Renda Fixa	Própria e Terceirizada	7.967,8	59,0	25	36,3	100	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	2.290,4	17,0	-	31,2	50	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	1.493,1	11,1	-	10,0	20	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	930,3	6,9	-	12,5	20	20	Art. 24	✓
Exterior	Terceirizada	818,7	6,1	-	10,0	10	10	Art. 26	✓
Outros ¹	Própria	2,2	0,02	-	-	-	-	-	-

¹ Disponível.

Alocação por emissor

%

Descrição	Gestão	Valor (R\$ mil)	RG	PI	Res. CMN nº 4.994		Status
					Patamar	Referência Art. 27	
Tesouro Nacional	Própria e Terceirizada	4.154,5	30,8	100	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5	20	Inciso II	✓
Itaú	Terceirizada	23,8	0,2				
Demais Emissores - Maior exposição				10	10	Inciso III	✓
Brad Ima-B5m	Própria	1.023,6	7,6				

Fonte: Nota Geris-2022/165, de 14 de junho.