

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 julho de 2023, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 24,4 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	17.044,3	70,0	25	63,7	100	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	3.003,6	12,3	-	11,8	50	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	1.924,3	7,9	-	8,5	20	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	1.305,5	5,4	-	8,0	20	20	Art. 24	✓
Exterior	Terceirizada	1.082,3	4,4	-	8,0	10	10	Art. 26	✓
Outros ¹	Própria e Terceirizada	4,1	0,00002	-	-	-	-	-	-

¹ Disponível, valores a receber e a pagar, inclusive do FIRFCP e FICFIM.

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	12.572,7	51,6	100	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5	20	Inciso II	✓
Bradesco	Terceirizada	21,5	0,1				
Demais Emissores - Maior exposição				10	10	Inciso III	✓
Ishares Ibovespa	Própria	1.340,6	5,5				

Fonte: Nota Geris-2023/235, de 14 de agosto.