

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

Recursos Garantidores

R\$ 25,1 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	17.882,1	71,2	25	63,7	100	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	2.854,5	11,4	-	11,8	50	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	1.913,9	7,6	-	8,5	20	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	1.320,9	5,3	-	8,0	20	20	Art. 24	✓
Exterior	Terceirizada	1.123,6	4,5	-	8,0	10	10	Art. 26	✓
Outros ¹	Própria e Terceirizada	2,9	0,00001	-	-	-	-	-	-

¹ Disponível, opções DI e 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	13.410,1	53,4	100	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5	20	Inciso II	✓
Bradesco	Terceirizada	30,6	0,1				
Demais Emissores - Maior exposição				10	10	Inciso III	✓
Ishares Ibovespa	Própria	1.276,5	5,1				

Fonte: Nota Geris-2023/272, de 14 de setembro.