

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

Recursos Garantidores

R\$ 25,3 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	18.256,3	72,2	25	63,7	100	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	2.755,9	10,9	-	11,8	50	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	1.914,8	7,6	-	8,5	20	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	1.223,8	4,8	-	8,0	20	20	Art. 24	✓
Exterior	Terceirizada	1.128,1	4,5	-	8,0	10	10	Art. 26	✓
Outros ¹	Própria e Terceirizada	7,8	0,00003	-	-	-	-	-	-

¹ Disponível 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	13.947,9	55,2	100	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5	20	Inciso II	✓
Bradesco	Terceirizada	32,0	0,1				
Demais Emissores - Maior exposição				10	10	Inciso III	✓
Ishares Ibovespa	Própria	1.245,9	4,9				

Fonte: Nota Geris-2023/337, de 13 de novembro.