

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

Recursos Garantidores

R\$ 27,7 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	21.309,2	77,0	25	63,7	100	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	2.516,7	9,1	-	11,8	50	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	1.551,7	5,6	-	8,5	20	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	1.130,8	4,1	-	8,0	20	20	Art. 24	✓
Exterior	Terceirizada	1.151,3	4,2	-	8,0	10	10	Art. 26	✓
Outros ¹	Própria e Terceirizada	25,1	0,0001	-	-	-	-	-	-

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	16.720,9	60,4	100	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5	20	Inciso II	✓
Bradesco	Própria e Terceirizada	34,9	0,1				
Demais Emissores - Maior exposição				10	10	Inciso III	✓
Brad Ima-B5m	Própria	1.213,4	4,4				

Fonte: Nota Geris-2024/014, de 15 de janeiro.