

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 janeiro de 2024, de modo a explicitar os limites de diversificação e concentração.

Recursos Garantidores

R\$ 27,9 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	21.678,6	77,7	25	65,9	100	100	Art. 21	✓
Renda Variável	Própria	2.395,2	8,6	-	8,9	50	70	Art. 22	✓
Estruturado	Terceirizada	1.531,9	5,5	-	6,5	20	20	Art. 23	✓
Imobiliário	Terceirizada	1.108,3	4,0	-	8,7	20	20	Art. 24	✓
Exterior	Terceirizada	1.175,5	4,2	-	10,0	10	10	Art. 26	✓
Outros ¹	Própria e Terceirizada	2,9	0,01	-	-	-	-	-	-

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	17.135,3	61,4	100	100	Inciso I	✓
Instituições Financeiras - Maior exposição				5	20	Inciso II	✓
Bradesco	Própria e Terceirizada	34,4	0,1				
Demais Emissores - Maior exposição				10	10	Inciso III	✓
Brad Ima-B5m	Própria	1.195,3	4,3				

Fonte: Nota Geris-2024/45, de 14 de fevereiro.