CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2022

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.778.693,24	5,10%	536	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	9.591.884,15	8,46%	1.027	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	4.880.201,94	4,31%	114	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	616.470,77	0,54%	245	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	14.654.551,58	12,93%	931	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	9.504.619,99	8,38%	1.058	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	14.926.574,52	13,17%	1.018	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.385.893,21	1,22%	829	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.423.257,57	4,78%	1.226	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.931.245,34	1,70%	309	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	14.661.311,88	12,93%	192	1,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.659.202,92	3,23%	138	0,38%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.131.176,12	1,00%	549	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	447.703,11	0,39%	247	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	204.677,30	0,18%	98	0,27%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	433.366,24	0,38%	5.169	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	1.597.901,75	1,41%	43.456	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.100.265,75	0,97%	2.448	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.442.705,08	2,15%	1.061	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.512.356,56	2,22%	161	0,53%	Artigo 8º, Inciso I

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

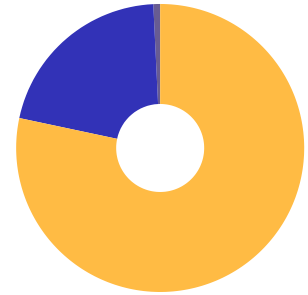
Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2022)

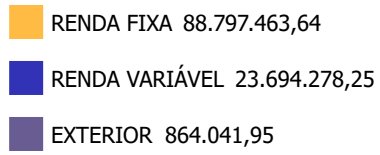
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.377.814,63	2,10%	1.872	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	2.950.658,77	2,60%	155	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	367.931,70	0,32%	9.283	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.086.217,01	1,84%	131	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	842.820,58	0,74%	32.260	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	463.024,52	0,41%	14.431	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.235.435,46	1,09%	8.449	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.243.868,92	1,10%	34	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	864.041,95	0,76%	530	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	538.189,06	0,47%	49.402	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.480.443,56	1,31%	12.118	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.826.338,66	1,61%	135	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	194.940,00	0,17%		0,19%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			**113.355.783,84**				

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Fevereiro / 2022)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	50,00%	56.677.891,92
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	68.693.392,31	60,60%	14,71%	45,00%	90,00%	33.326.813,15
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	19.899.394,03	17,55%	10,00%	17,00%	50,00%	36.778.497,89
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	22.671.156,77
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	204.677,30	0,18%	0,00%	0,20%	1,00%	928.880,54
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.667.789,19
Total Renda Fixa	100,00%	88.797.463,64	78,34%	24,71%	74,20%	216,00%	





Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	19.654.366,97	17,34%	10,00%	17,00%	30,00%	14.352.368,18
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.844.971,28	3,39%	2,00%	4,00%	10,00%	7.490.607,10
Artigo 11º	5,00%	194.940,00	0,17%	0,00%	0,20%	1,00%	938.617,84
Total Renda Variável	30,00%	23.694.278,25	20,90%	12,00%	21,20%	41,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	11.335.578,38
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	864.041,95	0,76%	0,00%	4,60%	10,00%	10.471.536,43
Total Exterior	10,00%	864.041,95	0,76%	0,00%	4,60%	20,00%	

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	64.764.907,53	57,13	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.487.135,89	20,72	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	20.232.844,29	17,85	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.290.523,69	1,14	0,00
TARPON INVESTIMENTOS	1.243.868,92	1,10	0,02
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.235.435,46	1,09	0,02
GENIAL INVESTIMENTOS	463.024,52	0,41	0,01
AZ QUEST INVESTIMENTOS	433.366,24	0,38	0,00
PETRA CAPITAL	204.677,30	0,18	0,02

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira $	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	68.693.392,31	60,60	14,71	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	19.899.394,03	17,55	10,00	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	204.677,30	0,18	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	19.654.366,97	17,34	10,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	864.041,95	0,76	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	3.844.971,28	3,39	2,00	10,00
Artigo 11º	194.940,00	0,17	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,72%	0,81%	1,76%	2,23%	2,73%	5,35%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	0,65%	1,57%	1,65%	1,74%	4,37%	0,87%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,26%	1,31%	2,15%	4,31%	6,70%	14,12%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	1,17%	1,89%	4,12%	6,30%	13,19%	1,15%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	1,17%	1,88%	4,11%	6,26%	13,10%	1,13%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,74%	1,38%	2,27%	2,93%	4,26%	7,47%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	1,34%	2,20%	2,83%	4,03%	7,01%	0,32%	0,01%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,75%	1,37%	2,23%	2,87%	4,05%	6,86%	0,32%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,06%	1,18%	1,97%	4,26%	6,32%	12,94%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05%	1,14%	1,92%	4,15%	6,07%	12,36%	1,06%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	-	-	-	-	-	1,33%	-
IMA-B (Benchmark)	0,54%	-0,19%	0,03%	0,73%	0,92%	4,12%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,53%	-0,23%	-0,03%	0,61%	0,65%	3,48%	1,78%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	0,58%	0,50%	2,40%	1,16%	0,48%	3,51%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59%	0,52%	2,40%	1,12%	0,24%	3,13%	1,23%	0,04%

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,75%	1,49%	2,26%	3,81%	5,65%	8,15%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	1,68%	2,47%	4,06%	5,80%	7,96%	0,06%	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,16%	-0,33%	-0,63%	-1,52%	-5,76%	-10,02%	0,01%	0,03%
IPCA (Benchmark)	1,01%	1,56%	2,30%	5,77%	10,54%	16,29%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,92%	1,74%	2,50%	3,80%	2,90%	-	0,12%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,81%	1,48%	2,32%	2,93%	1,86%	6,59%	0,35%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,91%	1,70%	2,28%	2,32%	4,59%	0,61%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,93%	1,46%	2,33%	4,51%	5,85%	8,44%	0,45%	0,02%

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	-2,90%	-8,00%	-3,99%	-3,05%	15,05%	48,42%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-2,56%	-7,83%	-2,97%	-1,50%	17,44%	-	10,39%	0,14%
Global BDRX (Benchmark)	-6,82%	-15,98%	-14,54%	-5,81%	1,83%	72,27%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,12%	-16,17%	-14,74%	-6,50%	-0,12%	68,54%	13,05%	0,19%
Ibovespa (Benchmark)	0,89%	7,94%	11,02%	-4,75%	2,82%	8,61%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,38%	1,02%	6,86%	-3,85%	10,64%	15,85%	5,27%	0,18%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-1,33%	4,32%	6,60%	-11,64%	-6,90%	-5,21%	6,20%	0,17%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-2,63%	-0,67%	-0,69%	-22,27%	-22,29%	-22,45%	10,59%	0,16%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	1,49%	12,90%	13,14%	-3,29%	2,91%	5,85%	5,74%	0,19%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-1,95%	4,70%	6,80%	-12,25%	-8,58%	-5,36%	6,08%	0,17%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	0,03%	5,51%	7,52%	-8,52%	-5,98%	-1,36%	6,03%	0,14%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	0,97%	10,54%	10,60%	-4,55%	1,20%	0,98%	5,44%	0,18%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	4,98%	6,39%	16,05%	6,50%	22,45%	62,96%	6,85%	0,19%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-1,21%	0,11%	1,09%	-13,89%	-7,48%	-3,23%	6,53%	0,14%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,37%	3,30%	7,52%	-1,86%	9,72%	16,21%	6,03%	0,14%
SMLL (Benchmark)	-5,19%	-1,95%	1,77%	-18,60%	-13,32%	-11,41%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-1,44%	2,47%	6,46%	-13,36%	-4,34%	-3,15%	7,40%	0,19%

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,47%	1,13%	3,47%	-11,11%	-7,61%	-11,59%	6,78%	0,15%
CDI (Benchmark)	0,75%	1,49%	2,26%	3,81%	5,65%	8,15%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,93%	2,37%	3,83%	2,49%	4,97%	10,22%	1,56%	0,03%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,84%	2,12%	3,59%	2,23%	4,28%	8,14%	1,27%	0,04%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,94%	2,27%	3,45%	3,11%	4,87%	8,71%	0,61%	0,02%
IFIX (Benchmark)	-1,29%	-2,27%	6,31%	-0,32%	-5,04%	-7,51%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-5,14%	-4,78%	-4,44%	-11,59%	-33,69%	-55,92%	11,63%	0,13%

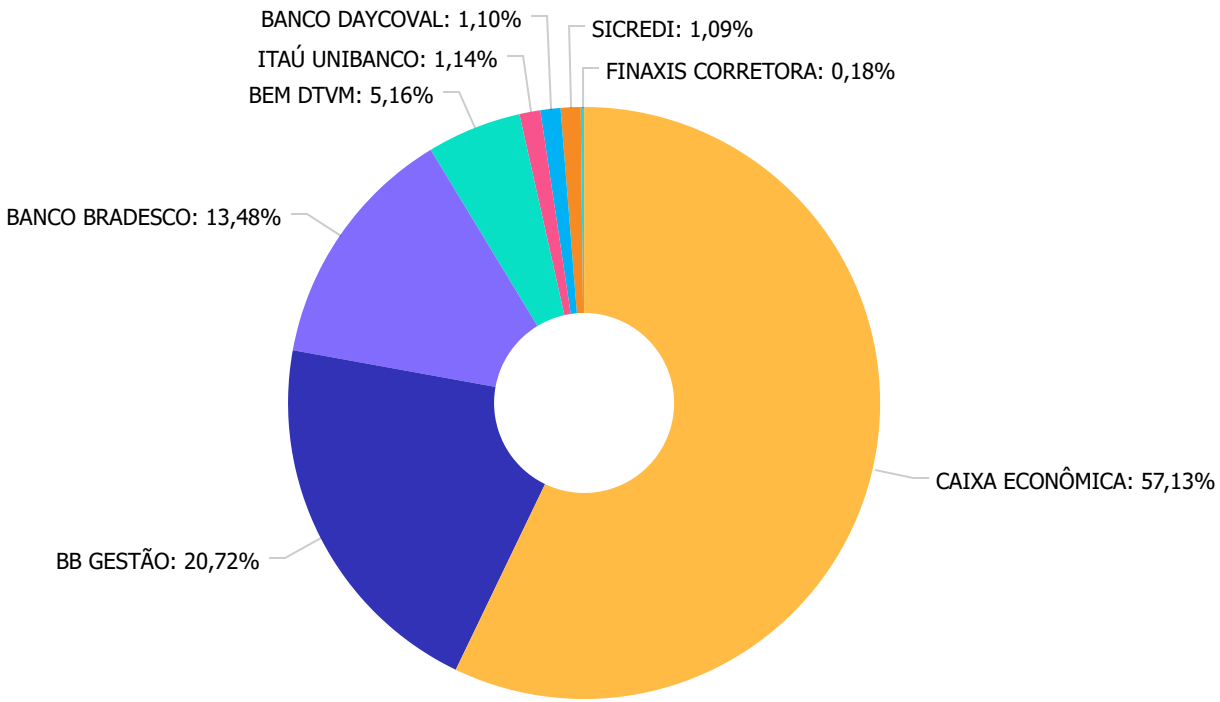
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-6,82%	-15,98%	-14,54%	-5,81%	1,83%	72,27%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,12%	-16,17%	-14,74%	-6,50%	-0,12%	68,54%	13,05%	0,19%

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

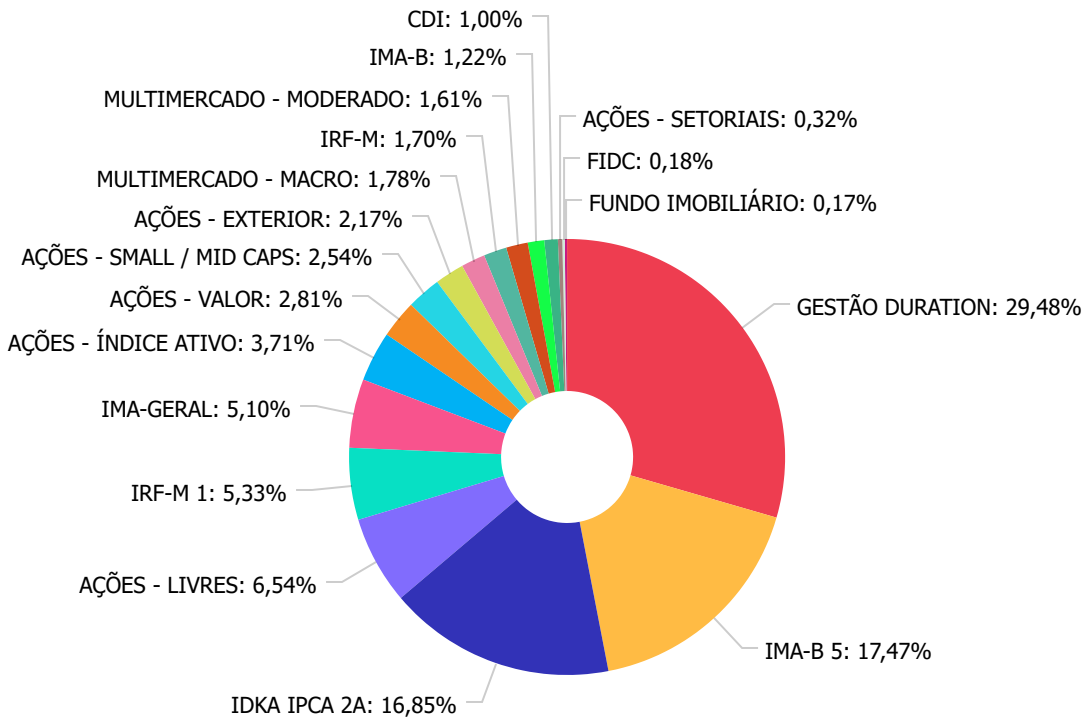
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2022)



CAIXA ECONÔMICA	64.764.907,53
BB GESTÃO	23.487.135,89
BANCO BRADESCO	15.277.782,65
BEM DTVM	5.851.452,40
ITAÚ UNIBANCO	1.290.523,69
BANCO DAYCOVAL	1.243.868,92
SICREDI	1.235.435,46
FINAXIS CORRETORA	204.677,30

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Fevereiro / 2022)

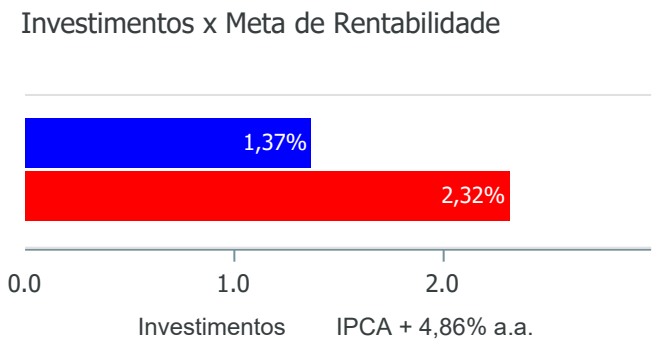


GESTÃO DURATION	33.422.769,49
IMA-B 5	19.806.776,46
IDKA IPCA 2A	19.096.504,14
AÇÕES - LIVRES	7.415.162,90
IRF-M 1	6.039.728,34
IMA-GERAL	5.778.693,24
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	4.210.816,54
AÇÕES - VALOR	3.186.482,76
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	2.876.071,32
AÇÕES - EXTERIOR	2.461.943,70
MULTIMERCADO - MACRO	2.018.632,62
IRF-M	1.931.245,34
MULTIMERCADO - MODERADO	1.826.338,66
IMA-B	1.385.893,21
CDI	1.131.176,12
AÇÕES - SETORIAIS	367.931,70
FIDC	204.677,30
FUNDO IMOBILIÁRIO	194.940,00

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

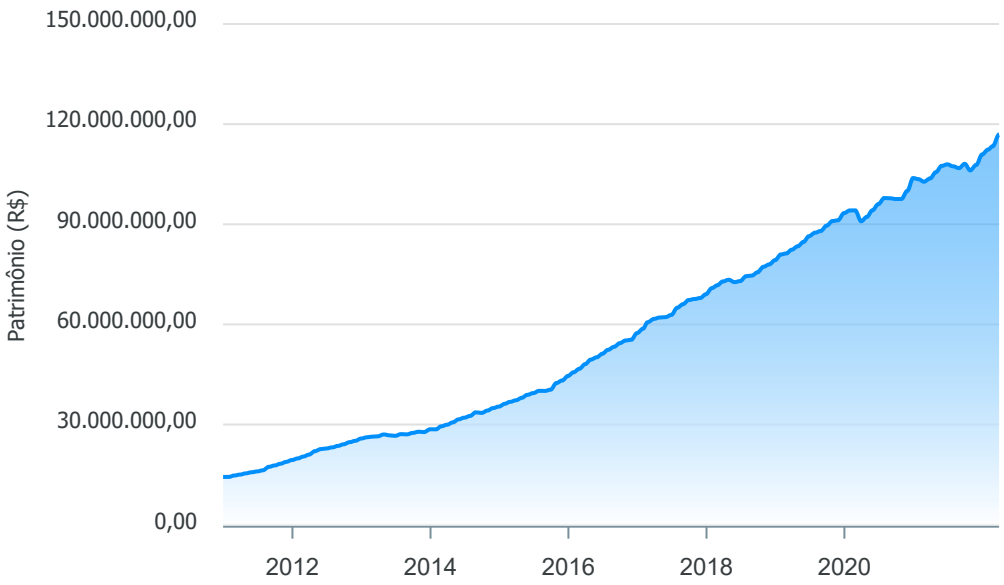
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	110.892.910,66	6.098.026,52	5.535.319,58	112.353.120,65	897.503,05	897.503,05	0,81%	0,81%	0,94%	0,94%	85,81%	2,48%
Fevereiro	112.353.120,65	1.146.323,76	778.317,91	113.355.783,84	634.657,34	1.532.160,39	0,56%	1,37%	1,37%	2,32%	59,09%	1,92%



Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

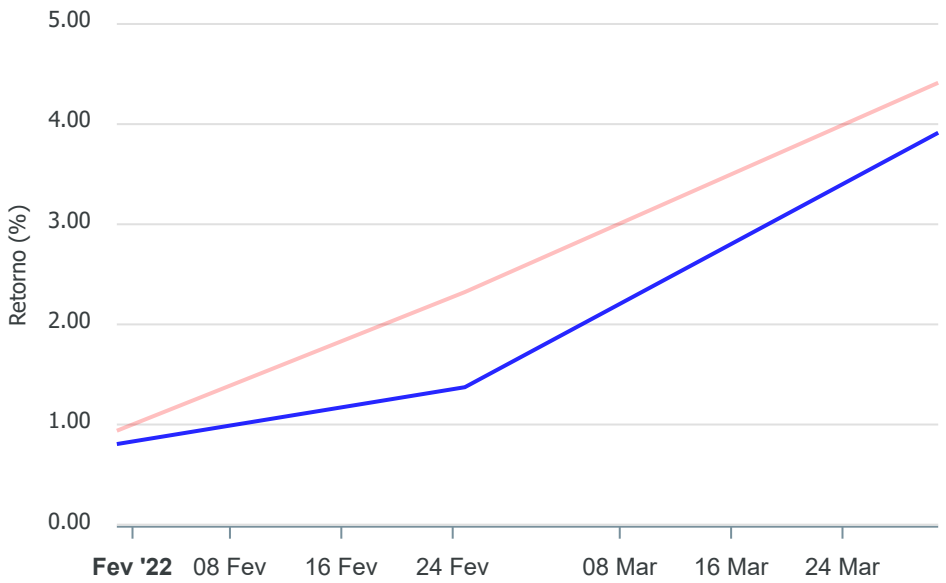
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO | 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	9.475.457,19	6.777,56	0,00	9.591.884,15	109.649,40	1,16%	1,16%	1,13%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.313.487,67	1.090.000,00	0,00	9.504.619,99	101.132,32	1,08%	1,15%	1,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	14.771.338,92	0,00	0,00	14.926.574,52	155.235,60	1,05%	1,05%	1,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	4.968.817,50	0,00	140.787,91	4.880.201,94	52.172,35	1,05%	1,06%	1,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	443.584,29	0,00	0,00	447.703,11	4.118,82	0,93%	0,93%	0,45%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.625.697,75	0,00	0,00	3.659.202,92	33.505,17	0,92%	0,92%	0,12%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.121.341,12	0,00	0,00	1.131.176,12	9.835,00	0,88%	0,88%	0,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	14.537.417,21	0,00	0,00	14.654.551,58	117.134,37	0,81%	0,81%	0,35%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	611.888,59	0,00	0,00	616.470,77	4.582,18	0,75%	0,75%	0,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.018.410,19	0,00	636.000,00	5.423.257,57	40.847,38	0,68%	0,72%	0,32%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	14.563.619,48	0,00	0,00	14.661.311,88	97.692,40	0,67%	0,67%	0,61%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.743.313,72	0,00	0,00	5.778.693,24	35.379,52	0,62%	0,62%	0,87%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.919.888,93	0,00	0,00	1.931.245,34	11.356,41	0,59%	0,59%	1,23%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.378.627,30	0,00	0,00	1.385.893,21	7.265,91	0,53%	0,53%	1,78%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	205.014,52	0,00	0,00	204.677,30	-337,22	-0,16%	-0,16%	0,01%
Total Renda Fixa	**87.697.904,38**	**1.096.777,56**	**776.787,91**	**88.797.463,64**	**779.569,61**	**0,89%**		**0,79%**

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	1.184.889,58	0,00	0,00	1.243.868,92	58.979,34	4,98%	4,98%	6,85%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	1.217.256,64	0,00	0,00	1.235.435,46	18.178,82	1,49%	1,49%	5,74%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.066.246,64	0,00	0,00	2.086.217,01	19.970,37	0,97%	0,97%	5,44%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	533.182,03	0,00	0,00	538.189,06	5.007,03	0,94%	0,94%	0,61%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.809.521,10	0,00	0,00	1.826.338,66	16.817,56	0,93%	0,93%	1,56%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.468.143,17	0,00	0,00	1.480.443,56	12.300,39	0,84%	0,84%	1,27%
PLURAL AÇÕES FIC AÇÕES	462.877,96	0,00	0,00	463.024,52	146,56	0,03%	0,03%	6,03%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.104.312,07	0,00	0,00	1.100.265,75	-4.046,32	-0,37%	-0,37%	6,03%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.961.968,18	0,00	0,00	2.950.658,77	-11.309,41	-0,38%	-0,38%	5,27%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	853.158,31	0,00	0,00	842.820,58	-10.337,73	-1,21%	-1,21%	6,53%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.409.825,18	0,00	0,00	2.377.814,63	-32.010,55	-1,33%	-1,91%	6,20%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.428.242,73	49.546,20	0,00	2.442.705,08	-35.083,85	-1,42%	-1,44%	7,40%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	439.847,25	0,00	0,00	433.366,24	-6.481,01	-1,47%	-1,47%	6,78%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.562.193,29	0,00	0,00	2.512.356,56	-49.836,73	-1,95%	-1,95%	6,08%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.639.924,60	0,00	0,00	1.597.901,75	-42.022,85	-2,56%	-2,56%	10,39%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	377.881,63	0,00	0,00	367.931,70	-9.949,93	-2,63%	-2,63%	10,59%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	205.500,00	0,00	1.530,00	194.940,00	-9.030,00	-4,39%	-5,14%	11,63%
Total Renda Variável	**23.724.970,36**	**49.546,20**	**1.530,00**	**23.694.278,25**	**-78.708,31**	**-0,33%**		**5,75%**

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Fevereiro / 2022) **FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	930.245,91	0,00	0,00	864.041,95	-66.203,96	-7,12%	-7,12%	13,05%
Total Exterior	**930.245,91**	**0,00**	**0,00**	**864.041,95**	**-66.203,96**	**-7,12%**		**13,05%**

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410