CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro 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 (Janeiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	48.608.934,88	3,05%	61.312	2,13%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	108.643,54	0,01%	34	0,19%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	2.156.521,49	0,14%	15	2,46%	Artigo 10º, Inciso II
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.213.673,23	0,08%	17	1,11%	Artigo 10º, Inciso II
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	5.273.121,86	0,33%	28	3,86%	Artigo 10º, Inciso II
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	2.163.365,34	0,14%		2,19%	Artigo 11º
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	5.311.447,18	0,33%		6,16%	Artigo 11º
TÍTULOS PÚBLICOS			142.977.006,12	8,96%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	93.088.983,91	5,83%	787	1,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	3.864.177,35	0,24%	165	1,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.194.951,09	0,33%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	15.116.917,98	0,95%	75	1,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	15/08/2030	15.809.050,46	0,99%	23	7,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	116.707.729,39	7,31%	941	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	168.046.699,13	10,53%	1.059	1,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	53.421.196,12	3,35%	7.028	7,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	17.217.741,09	1,08%	821	0,56%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+0	Não há	188.090.323,88	11,79%	413	2,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	20.346.312,79	1,28%	27	3,83%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	110.273.858,94	6,91%	534	0,75%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

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 (Janeiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	47.011.198,72	2,95%	97	9,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	100.208.941,67	6,28%	248	3,94%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	31.330.318,78	1,96%	23	7,91%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	D+1 du ...	Não há	25.498.615,84	1,60%	10.842	3,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR ...	Não se ...	Não se aplica	12.212,22	0,00%	137	2,87%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	24.828.462,49	1,56%	5.376	1,25%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	12.290.835,58	0,77%	34	0,62%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	39.075.095,84	2,45%	33.381	1,20%	Artigo 8º, Inciso I
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	56.366.622,08	3,53%	2.219	3,88%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	14.187.625,61	0,89%	2.827	1,20%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	30.549.396,95	1,91%	3.778	8,37%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	37.380.895,51	2,34%	37	3,18%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	D+63	Não há	36.349.719,36	2,28%	166	6,36%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.166.639,32	0,45%	995	5,34%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.228.008,15	0,27%	1.793	3,63%	Artigo 8º, Inciso I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	16.231.136,78	1,02%	7.520	3,12%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	31.056.678,61	1,95%	80	3,40%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	34.098.410,74	2,14%	12.913	3,16%	Artigo 9º, Inciso II
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO N...	D+5 du	Não há	12.029.753,30	0,75%	53	1,51%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	20.319.970,01	1,27%	41.933	2,59%	Artigo 9º, Inciso III

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 (Janeiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAPITÂNIA PORTFÓLIO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIV...	D+30 ou...	Não há	257.036,70	0,02%	12	1,30%	Desenquadrado - EST
Total para cálculo dos limites da Resolução			**1.595.468.230,03**				

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 (Janeiro / 2022)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 3	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

⚠ **ATENÇÃO!** Política de Investimentos de **2022** não está cadastrada !!!

ℹ **ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

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 (Janeiro / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 3	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

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 (Janeiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	425.954.255,90	26,70	-
ITAÚ UNIBANCO	217.625.555,01	13,64	0,02
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	208.436.636,67	13,06	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	165.547.550,97	10,38	0,01
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	142.977.006,12	8,96	-
WESTERN ASSET	114.059.884,30	7,15	0,23
VINCI PARTNERS	73.730.614,87	4,62	0,05
NAVI CAPITAL	56.366.622,08	3,53	3,73
XP ASSET MANAGEMENT	50.329.547,52	3,15	0,37
AZ QUEST INVESTIMENTOS	37.119.298,07	2,33	0,13
XP GESTÃO DE RECURSOS	36.893.263,31	2,31	0,00
SOMMA INVESTIMENTOS	30.549.396,95	1,91	-
OCCAM BRASIL	14.187.625,61	0,89	0,05
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	7.351.472,58	0,46	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	5.311.447,18	0,33	1,04
KPTL	5.273.121,86	0,33	1,69
REAG GESTORA DE RECURSOS	2.163.365,34	0,14	0,00
RJI CORRETORA DE VALORES	1.213.673,23	0,08	0,24
CAPITÂNIA	257.036,70	0,02	-
PLURAL	108.643,54	0,01	0,00
SILVERADO ASSET MANAGEMENT	12.212,22	0,00	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira $	Carteira %		

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 Janeiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
130% do CDI (Benchmark)	0,95%	0,95%	2,73%	4,54%	6,55%	10,08%	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-12,80%	-12,80%	-27,98%	-43,18%	-65,42%	-80,35%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,05%	0,05%	3,41%	3,29%	4,87%	13,47%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	3,17%	3,14%	4,54%	12,58%	1,11%	0,03%
IMA Geral (Benchmark)	0,21%	0,21%	2,90%	1,13%	1,42%	5,98%	-	-
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	-0,73%	-0,73%	3,02%	-1,96%	-2,98%	2,28%	2,30%	0,06%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,42%	3,32%	4,57%	12,47%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,08%	0,08%	3,33%	3,12%	4,25%	11,85%	1,00%	0,03%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,17%	-0,17%	3,17%	1,50%	0,50%	9,02%	1,47%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-0,73%	-0,73%	2,94%	-0,91%	-1,15%	4,02%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,09%	-1,09%	2,84%	-1,46%	-1,51%	4,58%	2,23%	0,06%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,03%	-0,03%	3,55%	0,25%	-2,05%	0,68%	1,31%	0,06%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,92%	-0,92%	3,70%	-3,14%	-7,37%	-5,46%	2,62%	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	0,56%	2,91%	4,19%	6,86%	12,96%	0,92%	0,02%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,41%	0,41%	3,68%	0,68%	0,05%	-28,57%	0,87%	0,05%

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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Selic (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,74%	0,74%	2,06%	3,47%	4,89%	7,17%	0,01%	0,01%
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	0,79%	2,18%	3,57%	4,96%	7,34%	0,02%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,65%	1,84%	2,91%	3,86%	5,35%	0,00%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,60%	0,60%	1,85%	6,13%	-	-	0,29%	-
IPCA (Benchmark)	0,54%	0,54%	2,24%	5,63%	10,38%	15,41%	-	-
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	-0,17%	-0,17%	3,50%	2,67%	3,76%	11,67%	1,33%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,52%	0,52%	3,06%	3,87%	4,94%	7,72%	0,38%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,67%	2,42%	0,62%	0,53%	6,39%	0,36%	0,03%

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 Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,38%	1,38%	4,86%	11,08%	21,97%	40,75%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,12%	-0,12%	-0,37%	-0,73%	-1,41%	-	-	0,02%
S&P 500 (Benchmark)	-5,26%	-5,26%	-1,95%	2,74%	21,57%	39,99%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-5,21%	-5,21%	-0,51%	5,60%	25,75%	40,32%	8,55%	0,14%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,19%	1,19%	4,25%	9,80%	19,21%	34,49%	-	-
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL FIP MULTIESTRATÉGIA	-7,96%	-7,96%	-52,13%	-52,29%	-50,85%	-	-	0,48%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-0,17%	-0,17%	-4,68%	-5,20%	2,53%	-	-	0,09%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,11%	1,11%	4,01%	9,29%	18,11%	32,03%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	-9,80%	-9,80%	16,65%	6,33%	-91,16%	-93,47%	37,71%	0,43%
IBX (Benchmark)	6,87%	6,87%	8,36%	-9,14%	-2,11%	-0,51%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,64%	2,64%	0,83%	-14,35%	-5,47%	-15,82%	9,39%	0,15%
Ibovespa (Benchmark)	6,98%	6,98%	8,35%	-7,93%	-2,54%	-1,42%	-	-
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	7,00%	7,00%	6,80%	-5,23%	-1,18%	-24,46%	10,28%	0,15%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	7,51%	7,51%	7,26%	-8,88%	-0,08%	-10,08%	9,32%	0,17%
OCCAM FIC AÇÕES	6,52%	6,52%	7,30%	-7,34%	-4,05%	-0,69%	8,11%	0,15%

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 Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	5,14%	5,14%	7,24%	-9,28%	-3,74%	1,28%	8,38%	0,16%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6,53%	6,53%	12,24%	-4,26%	6,03%	7,42%	10,27%	0,18%
XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	6,87%	6,87%	6,63%	-5,09%	-1,06%	-24,43%	10,15%	0,15%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,34%	1,34%	0,85%	-14,76%	-5,90%	-11,63%	10,71%	0,14%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	7,32%	7,32%	11,23%	-7,28%	-3,54%	-4,85%	10,99%	0,17%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,55%	2,55%	0,85%	-14,51%	-5,63%	-16,39%	8,85%	0,15%
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
CAPITÂNIA PORTFÓLIO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-1,68%	-1,68%	-2,48%	-4,26%	-8,00%	-54,06%	2,74%	0,06%
IPCA (Benchmark)	0,54%	0,54%	2,24%	5,63%	10,38%	15,41%	-	-
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,05%	-0,05%	-0,14%	-0,28%	-0,58%	-	-	0,00%
IFIX (Benchmark)	-0,99%	-0,99%	3,78%	-1,67%	-3,56%	-9,76%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-2,13%	-2,13%	91,52%	84,33%	71,32%	47,97%	-	-

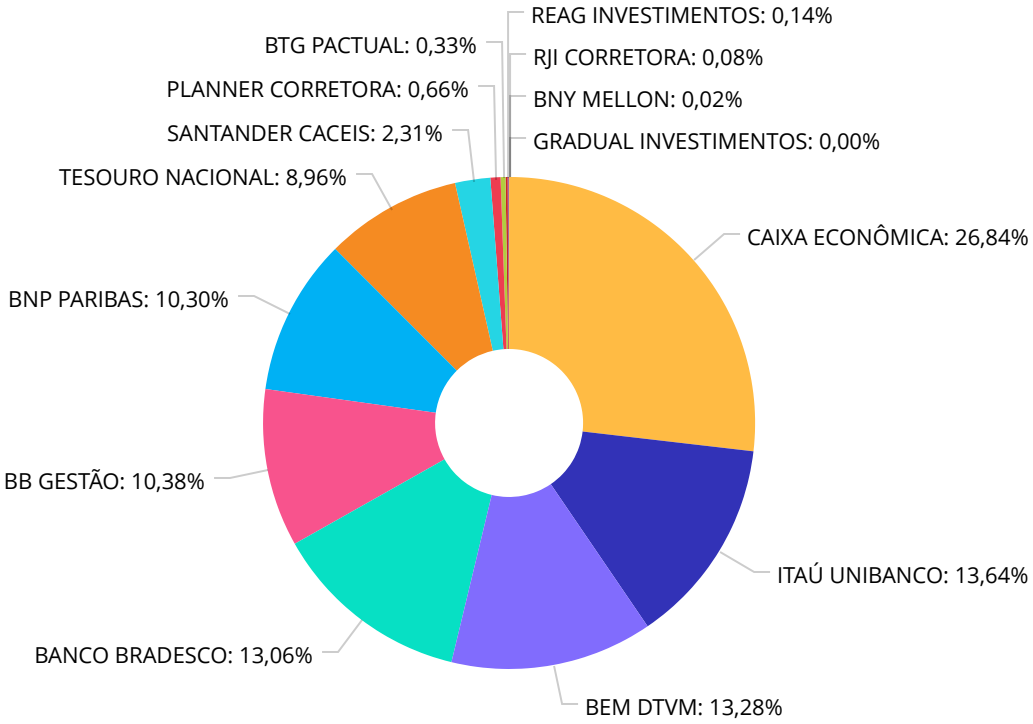
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,91%	-3,91%	-1,82%	1,85%	15,38%	-	9,90%	0,11%
MSCI WORLD (Benchmark)	-9,13%	-9,13%	-8,52%	4,26%	12,44%	63,87%	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	-17,86%	-17,86%	-22,26%	-14,80%	-15,54%	54,88%	16,91%	0,22%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MUL...	-3,12%	-3,12%	-1,66%	-0,46%	1,78%	4,92%	4,03%	0,09%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-15,52%	-15,52%	-12,90%	-3,21%	5,84%	73,67%	9,88%	0,22%
MSCI ACWI (Benchmark)	-8,76%	-8,76%	-8,61%	3,62%	9,17%	61,14%	-	-
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	-9,11%	-9,11%	-11,21%	-8,51%	4,46%	45,58%	13,62%	0,17%

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

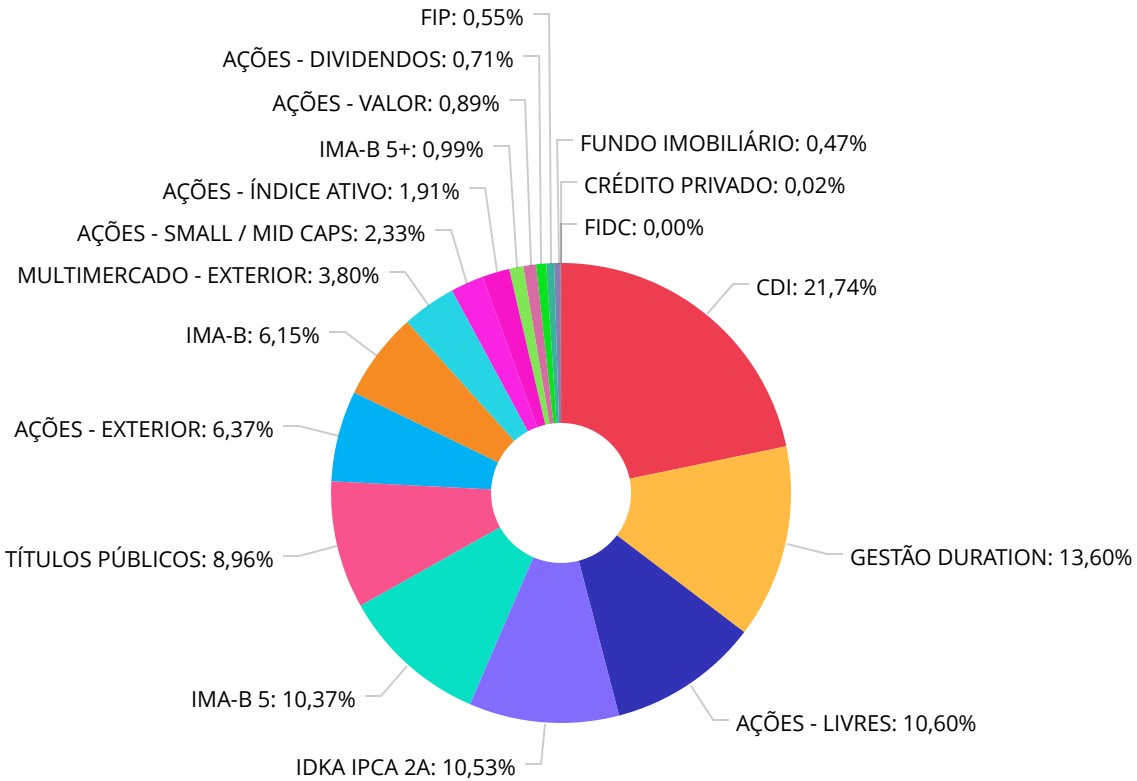
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2022)



CAIXA ECONÔMICA	428.219.420,93
ITAÚ UNIBANCO	217.625.555,01
BEM DTVM	211.953.557,58
BANCO BRADESCO	208.436.636,67
BB GESTÃO	165.547.550,97
BNP PARIBAS	164.389.431,82
TESOURO NACIONAL	142.977.006,12
SANTANDER CACEIS	36.893.263,31
PLANNER CORRETORA	10.584.569,04
BTG PACTUAL	5.194.951,09
REAG INVESTIMENTOS	2.163.365,34
RJI CORRETORA	1.213.673,23
BNY MELLON	257.036,70
GRADUAL INVESTIMENTOS	12.212,22

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 (Janeiro / 2022)



CDI	346.912.242,69
GESTÃO DURATION	216.916.671,06
AÇÕES - LIVRES	169.172.332,79
IDKA IPCA 2A	168.046.699,13
IMA-B 5	165.491.275,36
TÍTULOS PÚBLICOS	142.977.006,12
AÇÕES - EXTERIOR	101.706.196,14
IMA-B	98.051.078,44
MULTIMERCADO - EXTERIOR	60.638.688,18
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	37.119.298,07
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	30.549.396,95
IMA-B 5+	15.809.050,46
AÇÕES - VALOR	14.187.625,61
AÇÕES - DIVIDENDOS	11.394.647,47
FIP	8.751.960,12
FUNDO IMOBILIÁRIO	7.474.812,52
CRÉDITO PRIVADO	257.036,70
FIDC	12.212,22

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 de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2022)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	$ Pago	$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	03/09/2015	6.730	2.515,509771	3.826,654562	16.929.380,76	25.753.385,20	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6.185	2.315,991673	3.929,832796	14.324.408,50	24.306.015,84	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2.200	2.838,144079	3.992,917830	6.243.916,97	8.784.419,23	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8.310	2.412,107871	3.985,723856	20.044.616,41	33.121.365,24	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	25/10/2021	4.989	4.020,703935	4.071,340888	20.059.291,93	20.311.919,69	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	06/10/2021	6.026	4.195,899936	4.250,137556	25.284.493,01	25.611.328,91	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/10/2021	1.219	4.120,112709	4.174,382311	5.022.417,39	5.088.572,04	Curva

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

⚠ **ATENÇÃO!** Meta de Rentabilidade de **2022** não está cadastrada !!!

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 Janeiro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	115.933.747,94	0,00	0,00	116.707.729,39	773.981,45	0,67%	0,67%	0,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	3.842.493,44	0,00	0,00	3.864.177,35	21.683,91	0,56%	0,56%	0,92%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	129.278.049,35	57.833.035,08	0,00	188.090.323,88	979.239,45	0,52%	0,74%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	98.685.507,35	1.003.305,41	0,00	100.208.941,67	520.128,91	0,52%	0,52%	0,38%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.274.208,99	72.335.067,95	13.940.520,39	110.273.858,94	605.102,39	0,49%	0,79%	0,02%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.173.544,03	0,00	0,00	5.194.951,09	21.407,06	0,41%	0,41%	0,87%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.023.399,89	15.421.416,65	246.011,55	17.217.741,09	18.936,10	0,11%	0,65%	0,00%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	93.017.534,49	0,00	0,00	93.088.983,91	71.449,42	0,08%	0,08%	1,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,00	31.316.588,05	0,00	31.330.318,78	13.730,73	0,04%	0,60%	0,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	168.015.090,75	0,00	0,00	168.046.699,13	31.608,38	0,02%	0,02%	1,11%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.121.654,02	0,00	0,00	15.116.917,98	-4.736,04	-0,03%	-0,03%	1,31%
TÍTULOS PÚBLICOS	143.115.816,97	0,00	0,00	142.977.006,12	-138.810,85	-0,10%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	53.509.566,63	0,00	0,00	53.421.196,12	-88.370,51	-0,17%	-0,17%	1,47%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	25.542.905,44	0,00	0,00	25.498.615,84	-44.289,60	-0,17%	-0,17%	1,33%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.955.993,76	0,00	0,00	15.809.050,46	-146.943,30	-0,92%	-0,92%	2,62%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	94.075.874,89	0,00	72.833.057,03	20.346.312,79	-896.505,07	-0,95%	-0,73%	2,30%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	54.188.316,62	0,00	53.616.090,84	0,00	-572.225,78	-1,06%	-0,76%	2,01%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	47.530.728,83	0,00	0,00	47.011.198,72	-519.530,11	-1,09%	-1,09%	2,23%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	13.360,20	0,00	0,00	12.212,22	-1.147,98	-8,59%	-	-
Total Renda Fixa	**1.116.297.793,59**	**177.909.413,14**	**140.635.679,81**	**1.154.216.235,48**	**644.708,56**	**0,06%**		**0,70%**

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 Janeiro/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	28.416.117,34	0,00	0,00	30.549.396,95	2.133.279,61	7,51%	7,51%	9,32%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	34.831.170,03	0,00	0,00	37.380.895,51	2.549.725,48	7,32%	7,32%	10,99%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.951.440,23	0,00	0,00	4.228.008,15	276.567,92	7,00%	7,00%	10,28%
XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	6.705.975,75	0,00	0,00	7.166.639,32	460.663,57	6,87%	6,87%	10,15%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	52.913.606,32	0,00	0,00	56.366.622,08	3.453.015,76	6,53%	6,53%	10,27%
OCCAM FIC AÇÕES	13.318.993,96	0,00	0,00	14.187.625,61	868.631,65	6,52%	6,52%	8,11%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	34.573.409,22	0,00	0,00	36.349.719,36	1.776.310,14	5,14%	5,14%	8,38%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	24.190.008,81	0,00	0,00	24.828.462,49	638.453,68	2,64%	2,64%	9,39%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.984.746,02	0,00	0,00	12.290.835,58	306.089,56	2,55%	2,55%	8,85%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	30.591.976,48	0,00	31.313.322,51	0,00	721.346,03	2,36%	6,43%	10,20%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	38.557.709,82	0,00	0,00	39.075.095,84	517.386,02	1,34%	1,34%	10,71%
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	1.213.673,23	0,00	0,00	1.213.673,23	0,00	0,00%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	5.311.447,18	0,00	0,00	5.311.447,18	0,00	0,00%	-2,13%	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	5.279.528,85	0,00	0,00	5.273.121,86	-6.406,99	-0,12%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.160.271,77	0,00	0,00	2.156.521,49	-3.750,28	-0,17%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	2.203.681,12	0,00	0,00	2.163.365,34	-40.315,78	-1,83%	-9,80%	37,71%
CAPITÂNIA PORTFÓLIO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVAD...	267.267,80	0,00	0,00	257.036,70	-10.231,10	-3,83%	-1,68%	2,74%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	51.279.134,69	0,00	0,00	48.608.934,88	-2.670.199,81	-5,21%	-5,21%	8,55%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL FIP MULTIESTRATÉGIA	209.126,34	0,00	0,00	108.643,54	-100.482,80	-48,05%	-	-
Total Renda Variável	**347.959.284,96**	**0,00**	**31.313.322,51**	**327.516.045,11**	**10.870.082,66**	**3,12%**		**9,79%**

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 (Janeiro / 2022) **FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO ...	12.417.307,00	0,00	0,00	12.029.753,30	-387.553,70	-3,12%	-3,12%	4,03%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	21.146.155,09	0,00	0,00	20.319.970,01	-826.185,08	-3,91%	-3,91%	9,90%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	17.857.823,97	0,00	0,00	16.231.136,78	-1.626.687,19	-9,11%	-9,11%	13,62%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	36.763.733,13	0,00	0,00	31.056.678,61	-5.707.054,52	-15,52%	-15,52%	9,88%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	41.512.988,51	0,00	0,00	34.098.410,74	-7.414.577,77	-17,86%	-17,86%	16,91%
Total Exterior	**129.698.007,70**	**0,00**	**0,00**	**113.735.949,44**	**-15.962.058,26**	**-12,31%**		**11,91%**

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