CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto 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 (Agosto / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			176.912.317,29	10,34%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	99.041.199,41	5,79%	815	1,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+0	Não há	200.761.051,98	11,73%	431	2,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	2.645.239,96	0,15%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	15.114.336,30	0,88%	234	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	15/08/2030	15.772.300,96	0,92%	23	7,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	36.917.234,28	2,16%	814	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	94.823.243,30	5,54%	1.063	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	167.406.131,98	9,78%	613	0,94%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	56.350.090,67	3,29%	7.868	12,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	38.448.973,21	2,25%	1.015	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	21.323.716,64	1,25%	18	6,81%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	49.392.892,12	2,89%	85	11,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	76.116.563,58	4,45%	242	3,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	54.814.206,54	3,20%	83	4,59%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	D+1 du ...	Não há	27.015.770,38	1,58%	7.921	3,99%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	S/Info		30.328.106,33	1,77%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	S/Info		80.011.170,35	4,67%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	S/Info		101.073.033,92	5,91%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR ...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%	138	100,00%	Artigo 7º, Inciso V, 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 (Agosto / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	23.419.037,60	1,37%	4.250	1,44%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	11.691.253,76	0,68%	33	0,72%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	39.765.579,36	2,32%	24.093	1,58%	Artigo 8º, Inciso I
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	58.066.243,89	3,39%	1.681	3,74%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	14.158.818,38	0,83%	2.067	1,34%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	28.801.310,71	1,68%	2.928	8,38%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	35.157.137,08	2,05%	37	3,98%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	D+63	Não há	36.652.747,98	2,14%	157	7,03%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	13.035.349,68	0,76%	2.374	4,81%	Artigo 8º, Inciso I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	12.748.092,40	0,74%	4.420	4,85%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	27.792.800,30	1,62%	61	4,31%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	24.652.584,24	1,44%	9.161	3,99%	Artigo 9º, Inciso II
CAPITÂNIA PORTFÓLIO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIV...	D+30 ou...	Não há	238.126,47	0,01%	13	1,53%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	10.374.608,91	0,61%	20	6,37%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	14.456.115,69	0,84%	35.991	1,18%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	93.903,47	0,01%	34	0,18%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	2.359.515,32	0,14%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.206.350,10	0,07%	49	1,11%	Artigo 10º, Inciso II
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	5.211.662,88	0,30%	28	3,86%	Artigo 10º, Inciso II
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	2.305.770,51	0,13%		2,22%	Artigo 11º

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

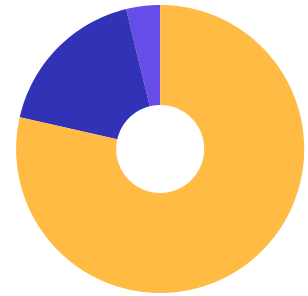
Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2022)

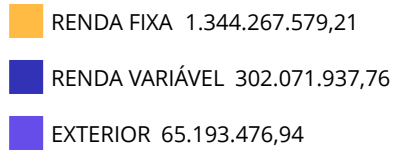
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	5.078.405,97	0,30%		8,03%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			**1.711.532.993,91**				

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

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 3	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	176.912.317,29	10,34%	3,00%	8,00%	40,00%	507.700.880,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	688.830.828,84	40,25%	5,00%	25,15%	70,00%	509.242.266,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	75,00%	267.112.122,47	15,61%	10,00%	34,00%	75,00%	1.016.537.622,96
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	211.412.310,60	12,35%	0,00%	0,00%	20,00%	130.894.288,18
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	15,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	17.115.329,93
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	256.729.949,09
Total Renda Fixa	100,00%	1.344.267.579,21	78,54%	18,00%	67,15%	221,00%	





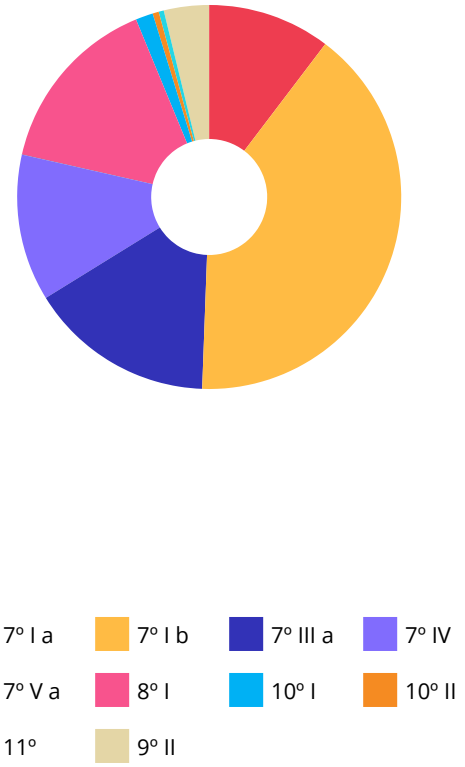
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

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 (Agosto / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 3	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	45,00%	260.747.478,44	15,23%	10,00%	20,00%	35,00%	338.289.069,43
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	25.068.851,07	1,46%	1,00%	4,00%	15,00%	231.661.098,02
Artigo 10º, Inciso II	10,00%	8.871.431,77	0,52%	0,00%	0,50%	2,00%	25.359.228,11
Artigo 11º	15,00%	7.384.176,48	0,43%	0,00%	0,60%	5,00%	78.192.473,22
Total Renda Variável	45,00%	302.071.937,76	17,65%	11,00%	25,10%	57,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 3	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	65.193.476,94	3,81%	1,00%	6,50%	10,00%	105.959.822,45
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,25%	5,00%	85.576.649,70
Total Exterior	10,00%	65.193.476,94	3,81%	1,00%	7,75%	15,00%	



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 (Agosto / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	330.033.246,82	19,28	1,16
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	222.084.768,62	12,98	0,02
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	176.912.317,29	10,34	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	165.282.972,92	9,66	-
ITAÚ DTVM	115.882.142,94	6,77	0,02
ITAÚ UNIBANCO	104.207.098,66	6,09	0,02
VINCI PARTNERS	71.809.885,06	4,20	0,06
WESTERN ASSET	70.806.206,36	4,14	0,15
NAVI CAPITAL	58.066.243,89	3,39	4,37
XP GESTÃO DE RECURSOS	40.051.120,06	2,34	0,01
XP ASSET MANAGEMENT	37.400.676,64	2,19	0,21
AZ QUEST INVESTIMENTOS	35.110.291,36	2,05	0,10
SOMMA INVESTIMENTOS	28.801.310,71	1,68	-
OCCAM BRASIL	14.158.818,38	0,83	0,07
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	10.374.608,91	0,61	1,00
KPTL	5.211.662,88	0,30	1,52
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	5.078.405,97	0,30	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	5.004.755,28	0,29	0,00
REAG GESTORA DE RECURSOS	2.305.770,51	0,13	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	1.206.350,10	0,07	0,23
CAPITÂNIA	238.126,47	0,01	-
PLURAL	93.903,47	0,01	-
SILVERADO ASSET MANAGEMENT	0,01	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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
130% do CDI (Benchmark)	1,52%	10,17%	4,25%	8,08%	13,46%	17,46%	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-100,00%	-	-	-	-	-	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,36%	6,28%	-0,07%	4,90%	9,42%	14,98%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,11%	5,99%	-0,18%	4,77%	9,08%	14,35%	1,43%	0,04%
IMA Geral (Benchmark)	1,40%	6,45%	2,32%	5,44%	7,87%	9,89%	-	-
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	1,31%	4,04%	-0,13%	4,39%	4,41%	6,37%	3,71%	0,06%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,00%	6,62%	0,35%	5,38%	9,88%	15,12%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,01%	6,48%	0,32%	5,28%	9,60%	14,55%	1,32%	0,04%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-3,13%	-0,05%	-3,23%	1,48%	2,97%	0,84%	5,10%	0,06%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,08%	5,31%	0,24%	4,51%	7,57%	9,08%	1,81%	0,04%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-50,69%	-48,87%	-50,45%	-48,07%	-47,36%	-47,52%	79,57%	0,52%
IMA-B (Benchmark)	1,10%	4,57%	-0,15%	4,78%	5,54%	8,99%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,86%	3,92%	-0,90%	4,28%	4,58%	7,85%	3,47%	0,07%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,70%	-1,15%	-2,88%	2,63%	0,48%	-3,29%	6,61%	0,07%
Selic (Benchmark)	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-

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 Agosto/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,16%	7,53%	3,20%	5,93%	9,97%	12,58%	0,01%	0,01%
CDI (Benchmark)	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,17%	7,85%	3,25%	6,07%	10,38%	12,85%	0,03%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,18%	7,90%	3,28%	6,21%	10,49%	13,56%	0,01%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,07%	8,54%	3,03%	6,85%	13,47%	-	0,12%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,36%	4,39%	-0,37%	2,79%	8,73%	19,25%	-	-
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,51%	5,77%	0,14%	5,13%	8,84%	14,48%	2,45%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,61%	6,77%	2,21%	5,24%	9,98%	11,78%	1,47%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,47%	6,96%	2,51%	5,40%	8,49%	8,48%	0,58%	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 Agosto/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,55%	11,58%	2,22%	8,14%	20,14%	45,55%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,13%	-1,29%	-0,31%	-1,06%	-1,74%	0,02%	-	0,00%
S&P 500 (Benchmark)	-4,24%	-17,02%	-4,29%	-9,80%	-12,55%	12,99%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-3,22%	-12,19%	-1,71%	-5,39%	-5,35%	23,41%	8,99%	0,21%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,34%	9,89%	1,62%	6,89%	17,43%	39,05%	-	-
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL FIP MULTIESTRATÉGIA	-8,07%	-11,95%	2,96%	2,00%	-54,31%	-68,46%	-	0,52%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-0,22%	9,22%	2,90%	3,92%	3,93%	11,54%	-	-
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,26%	9,21%	1,38%	6,39%	16,34%	36,49%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	6,30%	-5,35%	27,67%	8,14%	21,78%	-90,68%	38,50%	0,46%
Ibovespa (Benchmark)	6,16%	4,48%	-1,64%	-3,20%	-7,79%	10,22%	-	-
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,49%	22,44%	7,18%	10,64%	12,31%	14,24%	8,19%	0,16%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	6,87%	1,36%	-3,69%	-4,60%	-11,49%	2,81%	9,70%	0,23%
OCCAM FIC AÇÕES	7,11%	6,31%	0,88%	-1,24%	-5,22%	7,40%	8,78%	0,20%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	6,81%	6,01%	1,98%	1,32%	-5,90%	5,96%	8,16%	0,20%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,24%	9,74%	6,92%	3,43%	-0,81%	18,95%	9,04%	0,20%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,54%	3,13%	0,39%	3,02%	-11,29%	7,56%	7,56%	0,20%

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 Agosto/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5,90%	0,94%	-2,00%	-5,27%	-10,84%	3,63%	9,94%	0,23%
SMLL (Benchmark)	10,90%	-6,34%	-2,42%	-4,48%	-22,25%	-9,05%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,97%	-3,19%	-2,30%	-4,27%	-14,90%	-3,83%	8,25%	0,18%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,98%	-2,45%	-1,81%	-3,61%	-14,34%	-3,14%	8,24%	0,18%
CDI (Benchmark)	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-
CAPITÂNIA PORTFÓLIO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,22%	-6,79%	-4,92%	-5,05%	-9,99%	-15,39%	0,20%	0,07%
IPCA (Benchmark)	-0,36%	4,39%	-0,37%	2,79%	8,73%	19,25%	-	-
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,06%	-0,84%	-0,35%	-0,75%	-1,02%	-1,58%	-	0,00%
IFIX (Benchmark)	5,76%	6,11%	5,52%	8,58%	8,23%	6,98%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,53%	-28,26%	-3,28%	-27,65%	36,38%	28,29%	-	-

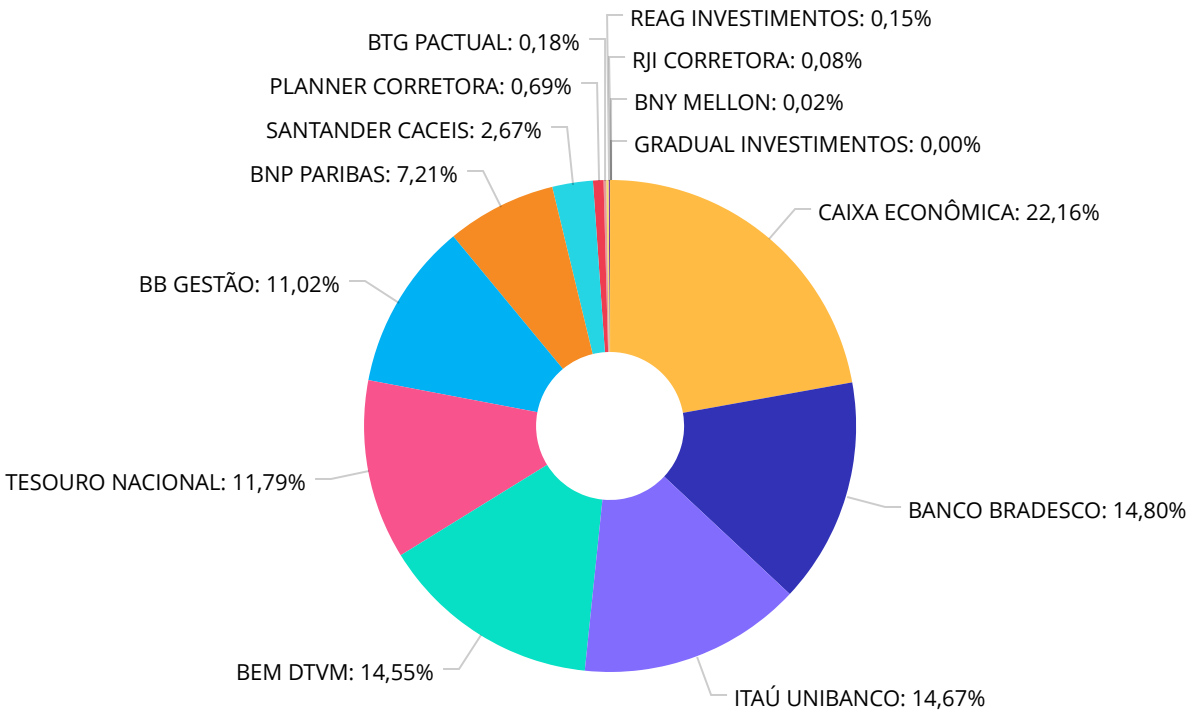
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	-4,51%	-24,55%	3,09%	-11,16%	-15,78%	1,28%	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	0,43%	-40,62%	9,04%	-19,89%	-39,28%	-32,62%	17,52%	0,29%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-2,28%	-24,40%	3,62%	-5,03%	-15,78%	10,35%	11,00%	0,22%
MSCI ACWI (Benchmark)	-4,03%	-24,62%	2,86%	-11,55%	-16,72%	-0,77%	-	-
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	-3,47%	-28,61%	-2,07%	-17,21%	-30,11%	-10,65%	10,77%	0,22%

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

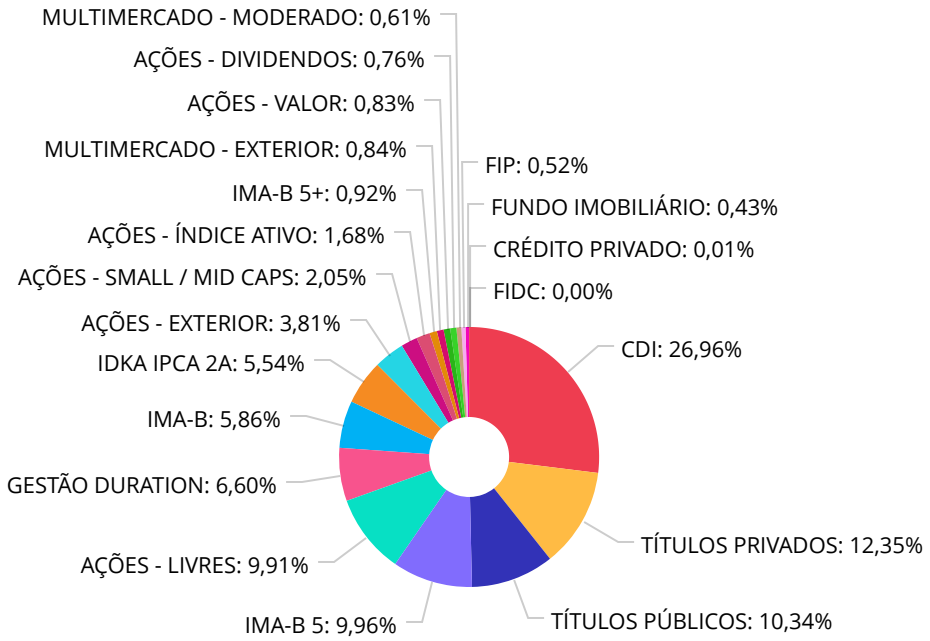
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2022)



CAIXA ECONÔMICA	332.486.665,61
BANCO BRADESCO	222.084.768,62
ITAÚ UNIBANCO	220.089.241,60
BEM DTVM	218.321.158,31
TESOURO NACIONAL	176.912.317,29
BB GESTÃO	165.282.972,92
BNP PARIBAS	108.206.883,00
SANTANDER CACEIS	40.051.120,06
PLANNER CORRETORA	10.290.068,85
BTG PACTUAL	2.645.239,96
REAG INVESTIMENTOS	2.305.770,51
RJI CORRETORA	1.206.350,10
BNY MELLON	238.126,47
GRADUAL INVESTIMENTOS	0,01

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 (Agosto / 2022)



CDI	461.430.363,71	TÍTULOS PRIVADOS	211.412.310,60	TÍTULOS PÚBLICOS	176.912.317,29	IMA-B 5	170.505.626,38
AÇÕES - LIVRES	169.641.708,31	GESTÃO DURATION	113.033.797,86	IMA-B	100.377.619,10	IDKA IPCA 2A	94.823.243,30
AÇÕES - EXTERIOR	65.193.476,94	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	35.110.291,36	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	28.801.310,71	IMA-B 5+	15.772.300,96
MULTIMERCADO - EXTERIOR	14.456.115,69	AÇÕES - VALOR	14.158.818,38	AÇÕES - DIVIDENDOS	13.035.349,68	MULTIMERCADO - MODERADO	10.374.608,91
FIP	8.871.431,77	FUNDO IMOBILIÁRIO	7.384.176,48	CRÉDITO PRIVADO	238.126,47	FIDC	0,01

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

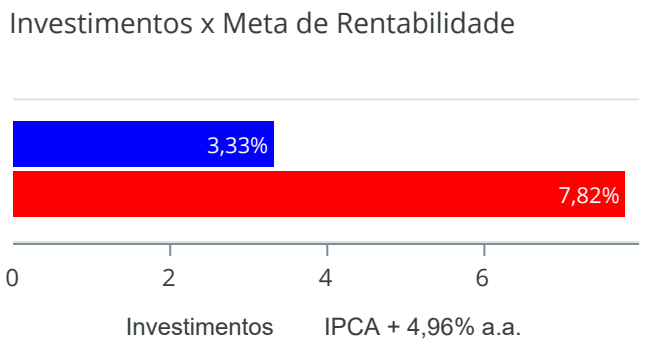
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2022)

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	3.981,200746	16.929.380,76	26.793.481,02	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6.185	2.315,991673	3.923,579627	14.324.408,50	24.267.339,99	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	01/02/2022	3.805	3.939,359049	4.002,543076	14.989.261,18	15.229.676,40	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	31/05/2022	3.719	4.032,45053800	3.975,389480	14.996.683,55	14.784.473,48	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2.200	2.838,144079	3.987,903919	6.243.916,97	8.773.388,62	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8.310	2.412,107871	4.060,164196	20.044.616,41	33.739.964,47	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	25/10/2021	4.989	4.020,703935	4.259,507264	20.059.291,93	21.250.681,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	06/10/2021	6.026	4.195,899936	4.439,803176	25.284.493,01	26.754.253,94	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/10/2021	1.219	4.120,112709	4.363,459950	5.022.417,39	5.319.057,68	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
Janeiro	1.584.847.627,18	177.677.341,48	171.761.492,56	1.586.248.130,09	-4.515.346,01	-4.515.346,01	-0,28%	-0,28%	0,95%	0,95%	-29,99%	3,57%
Fevereiro	1.586.248.130,09	42.477.623,47	33.124.753,04	1.595.467.796,84	-133.203,68	-4.648.549,69	-0,01%	-0,29%	1,38%	2,34%	-12,49%	3,08%
Março	1.595.467.796,84	29.478.253,20	19.192.158,66	1.638.476.989,94	32.723.098,56	28.074.548,87	2,04%	1,74%	2,05%	4,44%	39,21%	3,89%
Abril	1.638.476.989,94	42.509.172,57	36.314.572,46	1.627.600.461,52	-17.071.128,53	11.003.420,34	-1,04%	0,68%	1,43%	5,93%	11,53%	2,92%
Maio	1.627.600.461,52	38.246.580,37	39.863.330,23	1.650.551.941,46	24.568.229,80	35.571.650,14	1,51%	2,20%	0,90%	6,88%	32,03%	3,51%
Junho	1.650.551.941,46	52.512.747,93	45.137.811,21	1.632.483.632,23	-25.443.245,95	10.128.404,19	-1,53%	0,64%	1,08%	8,03%	7,91%	3,57%
Julho	1.632.483.632,23	259.090.375,59	248.836.096,23	1.662.949.349,03	20.211.437,44	30.339.841,63	1,23%	1,87%	-0,28%	7,73%	24,24%	2,56%
Agosto	1.662.949.349,03	30.600.188,38	24.066.621,65	1.693.417.385,25	23.934.469,49	54.274.311,12	1,43%	3,33%	0,08%	7,82%	42,65%	3,13%

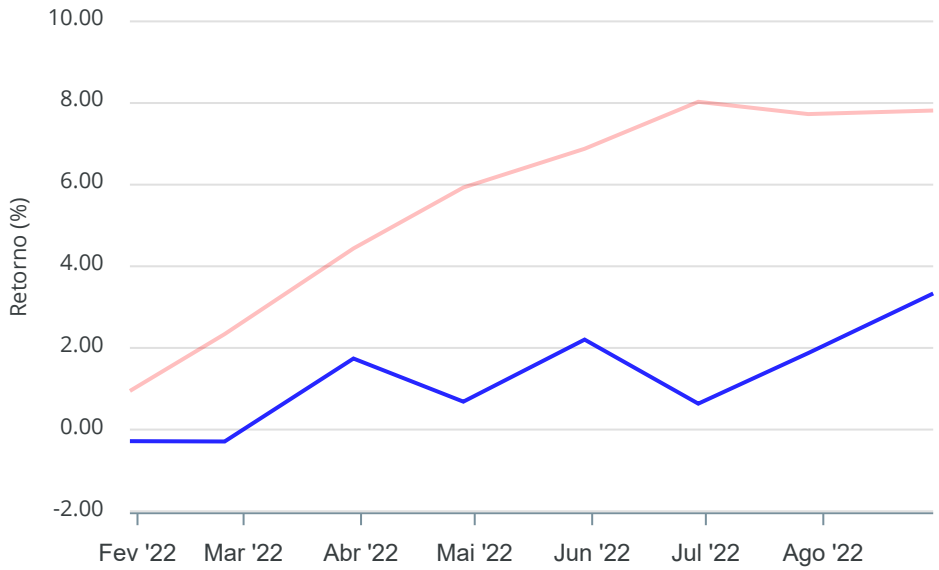


Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO | 36M

Comparativo



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

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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/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	36.381.476,44	0,00	0,00	36.917.234,28	535.757,84	1,47%	1,47%	0,58%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	21.047.547,57	0,00	0,00	21.323.716,64	276.169,07	1,31%	1,31%	3,71%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	198.466.234,84	0,00	0,00	200.761.051,98	2.294.817,14	1,16%	1,16%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	54.233.875,47	0,00	0,00	54.814.206,54	580.331,07	1,07%	1,07%	0,12%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	16.044.444,44	0,00	442.685,76	15.772.300,96	170.542,28	1,06%	-1,70%	6,61%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	32.380.676,56	5.927.881,60	250.000,00	38.448.973,21	390.415,05	1,02%	1,18%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	155.364.050,36	24.672.306,78	14.454.577,29	167.406.131,98	1.824.352,13	1,01%	1,17%	0,03%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	48.969.620,01	0,00	0,00	49.392.892,12	423.272,11	0,86%	0,86%	3,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	4.034.362,34	0,00	4.060.163,50	0,00	25.801,16	0,64%	1,19%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	75.655.050,75	0,00	0,00	76.116.563,58	461.512,83	0,61%	0,61%	1,47%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	26.879.209,09	0,00	0,00	27.015.770,38	136.561,29	0,51%	0,51%	2,45%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.364.579,18	0,00	2.739.390,93	2.645.239,96	20.051,71	0,37%	-50,69%	79,57%
TÍTULOS PÚBLICOS	178.188.982,63	0,00	1.867.646,10	176.912.317,29	590.980,76	0,33%	-	-
LETRA FINANCEIRA SANTANDER	100.907.338,43	0,00	0,00	101.073.033,92	165.695,49	0,16%	0,00%	0,00%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	56.308.140,76	0,00	0,00	56.350.090,67	41.949,91	0,07%	0,07%	1,81%
LETRA FINANCEIRA ITAU UNIBANCO	79.991.291,03	0,00	0,00	80.011.170,35	19.879,32	0,02%	0,00%	0,00%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	99.035.143,95	0,00	0,00	99.041.199,41	6.055,46	0,01%	0,01%	1,32%
LETRA FINANCEIRA BRADESCO	30.331.663,27	0,00	0,00	30.328.106,33	-3.556,94	-0,01%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	94.926.476,71	0,00	0,00	94.823.243,30	-103.233,41	-0,11%	-0,11%	1,43%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.602.780,07	0,00	466.440,45	15.114.336,30	-22.003,32	-0,14%	-3,13%	5,10%

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 Agosto/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.306,33	0,00	0,00	0,01	-1.306,32	-100,00%	-	-
Total Renda Fixa	**1.330.114.250,23**	**30.600.188,38**	**24.280.904,03**	**1.344.267.579,21**	**7.834.044,63**	**0,59%**		**1,08%**

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 Agosto/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAPITÂNIA PORTFÓLIO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVAD...	237.596,09	0,00	35.717,62	238.126,47	36.248,00	15,26%	0,22%	0,20%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	53.156.525,49	0,00	0,00	58.066.243,89	4.909.718,40	9,24%	9,24%	9,04%
OCCAM FIC AÇÕES	13.219.424,40	0,00	0,00	14.158.818,38	939.393,98	7,11%	7,11%	8,78%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	26.950.699,09	0,00	0,00	28.801.310,71	1.850.611,62	6,87%	6,87%	9,70%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	34.316.803,23	0,00	0,00	36.652.747,98	2.335.944,75	6,81%	6,81%	8,16%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	37.325.217,02	0,00	0,00	39.765.579,36	2.440.362,34	6,54%	6,54%	7,56%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	12.241.151,89	0,00	0,00	13.035.349,68	794.197,79	6,49%	6,49%	8,19%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	2.169.051,88	0,00	0,00	2.305.770,51	136.718,63	6,30%	6,30%	38,50%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.031.811,55	0,00	0,00	11.691.253,76	659.442,21	5,98%	5,98%	8,24%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	22.099.007,03	0,00	0,00	23.419.037,60	1.320.030,57	5,97%	5,97%	8,25%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	33.198.499,58	0,00	0,00	35.157.137,08	1.958.637,50	5,90%	5,90%	9,94%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	9.942.024,19	0,00	0,00	10.374.608,91	432.584,72	4,35%	4,35%	7,55%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	5.078.405,97	0,00	0,00	5.078.405,97	0,00	0,00%	0,53%	-
LSH FIP MULTIESTRATÉGIA	1.207.051,05	0,00	0,00	1.206.350,10	-700,95	-0,06%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	5.218.569,96	0,00	0,00	5.211.662,88	-6.907,08	-0,13%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.364.594,84	0,00	0,00	2.359.515,32	-5.079,52	-0,21%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	14.936.327,52	0,00	0,00	14.456.115,69	-480.211,83	-3,22%	-3,22%	8,99%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL FIP MULTIESTRATÉGIA	102.143,44	0,00	0,00	93.903,47	-8.239,97	-8,07%	-	-
Total Renda Variável	**284.794.904,22**	**0,00**	**35.717,62**	**302.071.937,76**	**17.312.751,16**	**6,08%**		**8,92%**

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

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	24.546.833,53	0,00	0,00	24.652.584,24	105.750,71	0,43%	0,43%	17,52%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	28.441.085,59	0,00	0,00	27.792.800,30	-648.285,29	-2,28%	-2,28%	11,00%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	13.205.690,57	0,00	0,00	12.748.092,40	-457.598,17	-3,47%	-3,47%	10,77%
Total Exterior	**66.193.609,69**	**0,00**	**0,00**	**65.193.476,94**	**-1.000.132,75**	**-1,51%**		**13,42%**

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