CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2021

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 (Dezembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	875.764,26	3,07%	553	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	3.635.745,71	12,74%	1.035	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.161.076,18	4,07%	788	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.147.368,95	11,03%	945	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.399.676,66	8,41%	1.060	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.972.306,06	10,42%	1.023	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	467.340,08	1,64%	46	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.449.075,35	5,08%	590	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.070.718,34	3,75%	854	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	288.257,26	1,01%	865	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	767.254,86	2,69%	128	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	820.675,81	2,88%	99	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	125.845,98	0,44%	247	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.909.258,34	6,69%	2.203	0,19%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	571.522,83	2,00%	112	0,10%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	118.042,41	0,41%	838	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	969.580,73	3,40%	48.889	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	380.363,23	1,33%	8.923	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	174.646,69	0,61%	9.819	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	363.400,39	1,27%	5.354	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, 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

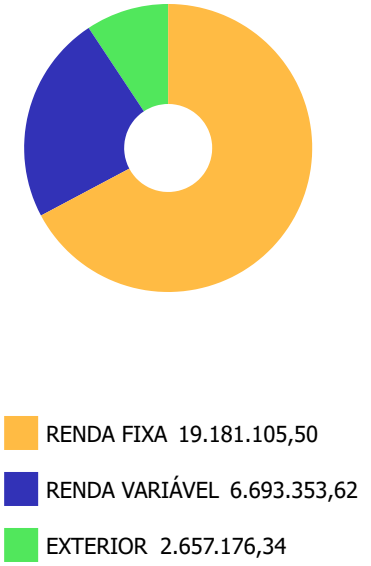
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	D+3	Não há	436.369,45	1,53%	16.104	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	410.043,38	1,44%	151.964	0,00%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.360.126,17	4,77%	19.787	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	394.083,00	1,38%	25.475	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.263.093,34	7,93%	529	0,06%	Artigo 9º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			**28.531.635,46**				

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

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	14.659.277,90	51,38%	11,50%	57,60%	90,00%	11.019.194,01
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	4.521.827,60	15,85%	4,10%	20,30%	40,00%	6.890.826,58
Total Renda Fixa	100,00%	19.181.105,50	67,23%	15,60%	77,90%	130,00%	

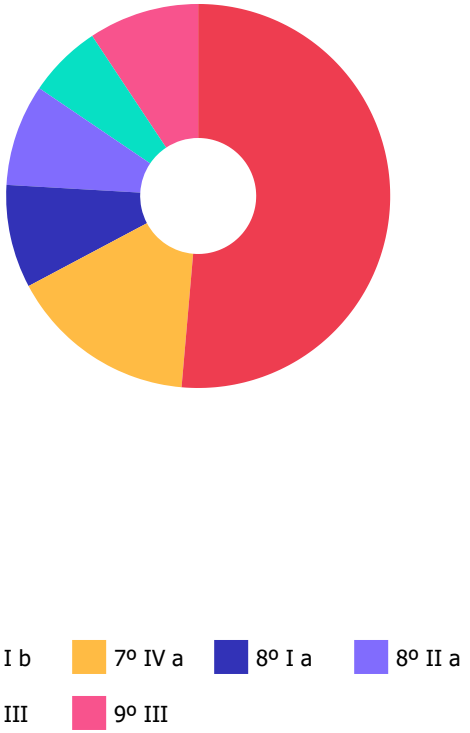


Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	2.480.781,17	8,69%	0,00%	0,00%	20,00%	3.225.545,92
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	2.442.402,90	8,56%	0,00%	18,50%	20,00%	3.263.924,19
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.770.169,55	6,20%	0,00%	3,00%	10,00%	1.082.994,00
Total Renda Variável	30,00%	6.693.353,62	23,46%	0,00%	21,50%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,30%	10,00%	2.853.163,55
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.657.176,34	9,31%	0,00%	0,30%	10,00%	195.987,21
Total Exterior	10,00%	2.657.176,34	9,31%	0,00%	0,60%	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

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	14.307.653,21	50,15	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.373.750,93	43,37	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.850.231,32	6,48	0,00

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 - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira $	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	14.659.277,90	51,38	11,50	90,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	4.521.827,60	15,85	4,10	40,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	2.480.781,17	8,69	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	2.442.402,90	8,56	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	1.770.169,55	6,20	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	2.657.176,34	9,31	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 Dezembro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,94%	0,61%	1,38%	0,96%	0,61%	5,49%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	-0,40%	0,99%	0,29%	-0,40%	4,67%	1,00%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,83%	4,97%	1,84%	3,05%	4,97%	14,02%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,72%	4,66%	1,82%	3,05%	4,66%	13,07%	1,10%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,65%	1,86%	3,18%	4,65%	12,93%	1,05%	0,03%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	0,72%	4,61%	1,81%	3,03%	4,61%	13,05%	1,09%	0,03%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,79%	4,57%	2,03%	3,24%	4,57%	12,97%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	4,31%	1,97%	3,12%	4,31%	12,39%	1,02%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	4,27%	1,94%	3,06%	4,27%	12,38%	1,04%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	0,22%	-1,26%	1,06%	-0,55%	-1,26%	5,06%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,09%	-1,47%	0,38%	-0,61%	-1,47%	5,95%	2,27%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,75%	4,60%	1,89%	3,40%	4,60%	7,12%	0,04%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,76%	4,52%	1,87%	3,35%	4,52%	7,30%	0,05%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	4,62%	1,93%	3,26%	4,62%	7,13%	0,03%	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

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,73%	10,06%	2,96%	6,07%	10,06%	15,03%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,83%	-0,11%	1,07%	-0,82%	-0,11%	6,55%	0,23%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	0,54%	1,40%	0,93%	0,54%	-	0,79%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,86%	4,53%	2,16%	3,49%	4,53%	7,52%	0,23%	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 Dezembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	4,36%	26,89%	10,65%	10,91%	26,89%	47,52%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5,28%	30,30%	12,24%	12,99%	30,30%	-	7,90%	0,11%
Ibovespa (Benchmark)	2,85%	-11,93%	-5,55%	-17,33%	-11,93%	-9,36%	-	-
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	2,86%	-12,11%	-5,59%	-17,34%	-12,11%	-9,70%	8,95%	0,15%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3,06%	-8,16%	-4,10%	-10,41%	-8,16%	-7,65%	10,19%	0,16%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-0,04%	-27,27%	-16,67%	-29,23%	-27,27%	-26,63%	10,38%	0,16%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	3,44%	-11,53%	-6,39%	-19,00%	-11,53%	-9,52%	9,23%	0,16%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	-0,29%	-20,61%	-12,80%	-23,75%	-20,61%	-16,62%	9,02%	0,15%
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,73%	4,37%	1,82%	3,06%	4,37%	8,69%	0,12%	0,01%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-0,02%	-26,98%	-16,69%	-28,90%	-26,98%	-27,40%	10,46%	0,16%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,56%	32,83%	13,07%	14,36%	32,83%	47,69%	7,98%	0,11%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3,10%	-13,19%	-5,43%	-18,78%	-13,19%	-14,75%	9,14%	0,15%

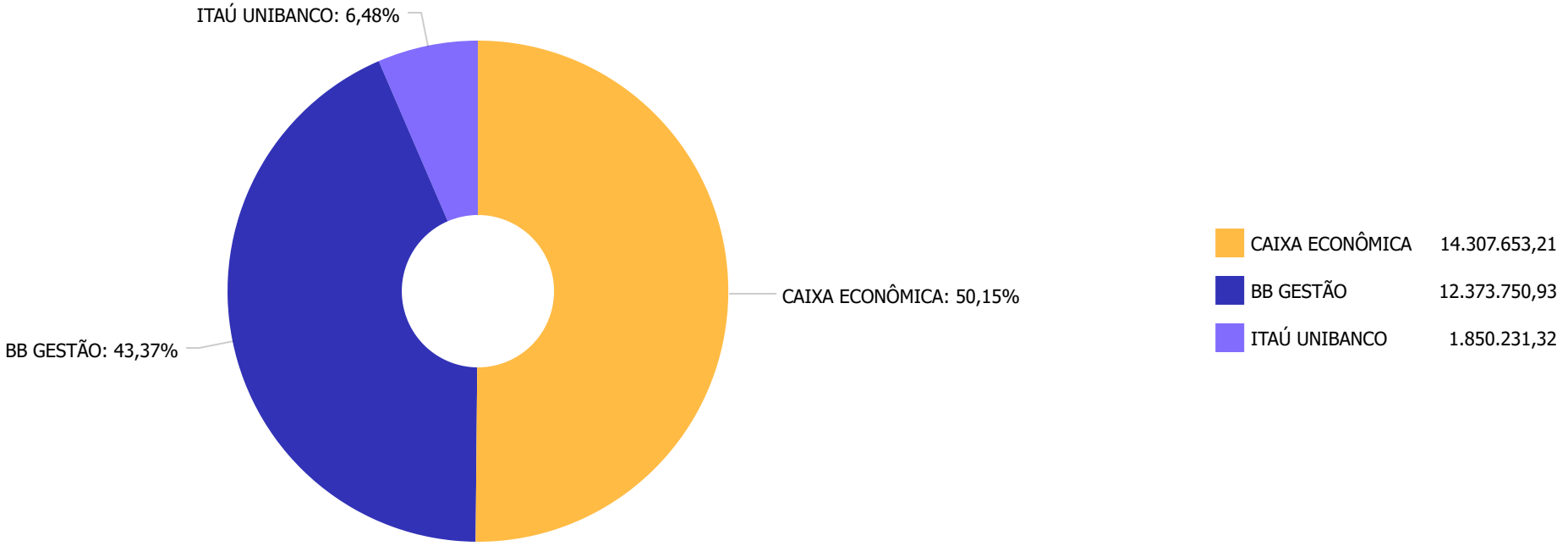
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,71%	33,65%	12,29%	21,44%	33,65%	105,84%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,90%	32,16%	12,22%	22,40%	32,16%	94,37%	8,37%	0,13%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70%	30,51%	11,81%	20,44%	30,51%	101,98%	8,95%	0,14%

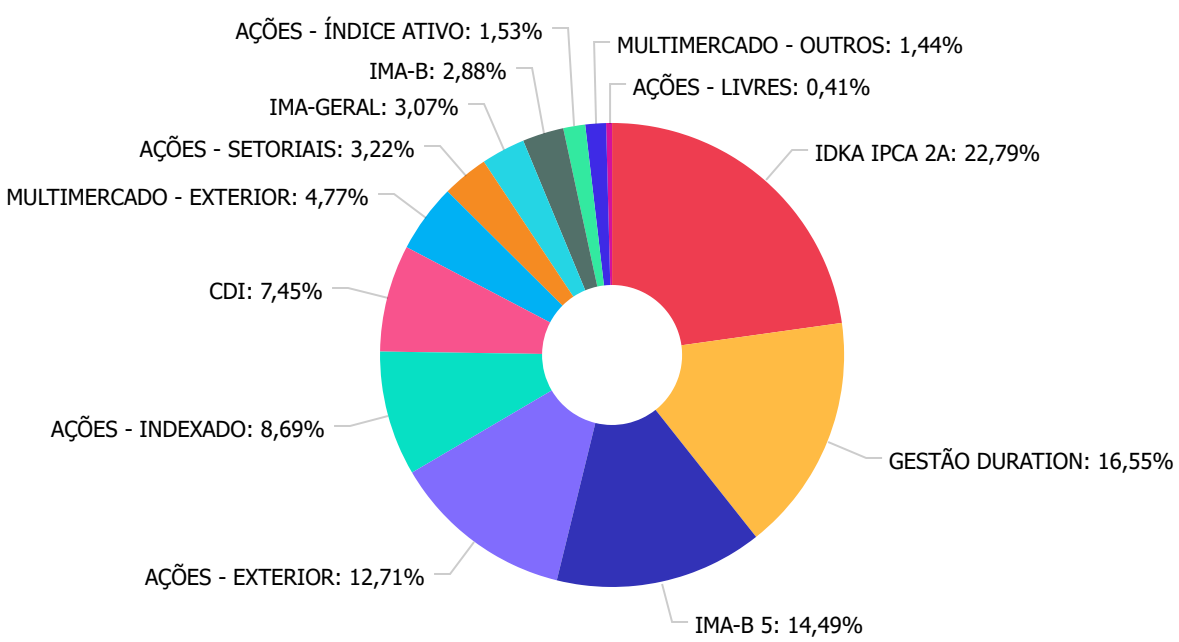
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2021)



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 (Dezembro / 2021)

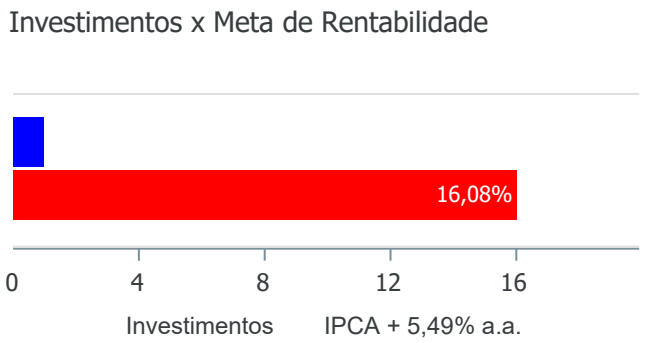


IDKA IPCA 2A	6.502.762,45
GESTÃO DURATION	4.722.290,28
IMA-B 5	4.133.382,24
AÇÕES - EXTERIOR	3.626.757,07
AÇÕES - INDEXADO	2.480.781,17
CDI	2.126.230,46
MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.360.126,17
AÇÕES - SETORIAIS	918.410,31
IMA-GERAL	875.764,26
IMA-B	820.675,81
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	436.369,45
MULTIMERCADO - OUTROS	410.043,38
AÇÕES - LIVRES	118.042,41

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 2021

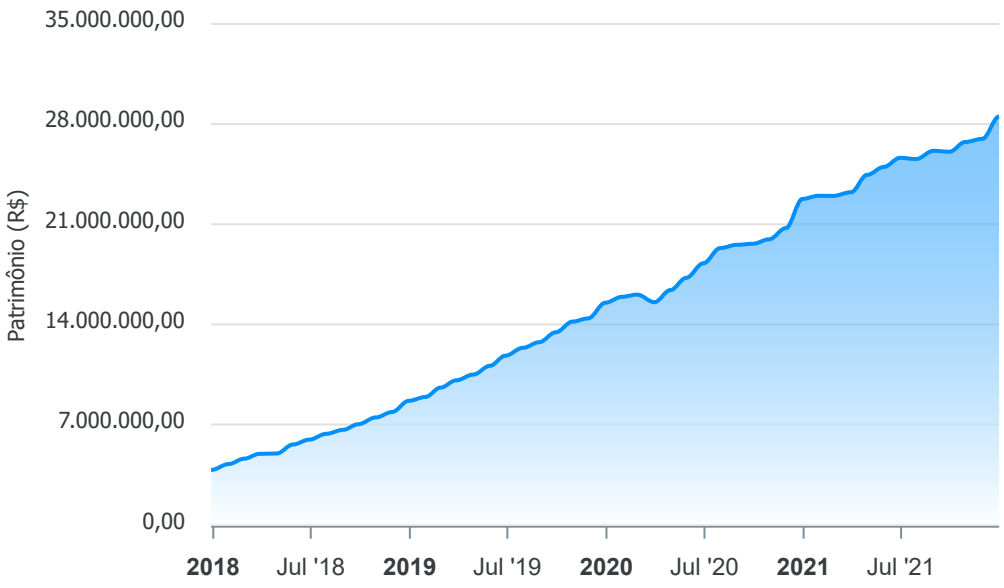
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	22.772.956,95	0,00	0,00	22.550.218,70	-222.738,25	-222.738,25	-0,98%	-0,98%	0,68%	0,68%	-144,66%	6,33%
Fevereiro	22.550.218,70	438.353,49	1.556,75	22.512.258,24	-474.757,20	-697.495,45	-2,07%	-3,02%	1,25%	1,93%	-156,62%	4,78%
Março	22.512.258,24	7.135.146,51	6.958.311,55	22.944.301,61	255.208,41	-442.287,04	1,12%	-1,93%	1,42%	3,38%	-57,15%	5,68%
Abril	22.944.301,61	3.494.499,75	2.543.195,58	24.236.932,14	341.326,36	-100.960,68	1,43%	-0,53%	0,74%	4,14%	-12,83%	3,65%
Maio	24.236.932,14	1.148.854,33	648.857,43	25.008.296,27	271.367,23	170.406,55	1,10%	0,56%	1,28%	5,48%	10,22%	3,61%
Junho	25.008.296,27	1.510.027,13	930.331,27	25.644.129,34	56.137,21	226.543,76	0,22%	0,78%	0,98%	6,51%	11,99%	2,82%
Julho	25.644.129,34	1.502.144,30	1.502.144,30	25.559.970,82	-84.158,52	142.385,24	-0,33%	0,45%	1,43%	8,03%	5,59%	3,63%
Agosto	25.559.970,82	1.025.013,79	400.000,00	26.134.226,09	-50.758,52	91.626,72	-0,19%	0,25%	1,34%	9,48%	2,69%	3,23%
Setembro	26.134.226,09	667.347,55	459.267,66	26.070.020,47	-272.285,51	-180.658,79	-1,03%	-0,78%	1,61%	11,25%	-6,95%	3,63%
Outubro	26.070.020,47	1.040.848,99	230.000,00	26.750.211,50	-130.657,96	-311.316,75	-0,49%	-1,26%	1,68%	13,12%	-9,64%	4,24%
Novembro	26.750.211,50	1.820,55	75,00	26.973.446,49	221.489,44	-89.827,31	0,83%	-0,45%	1,38%	14,68%	-3,04%	3,88%
Dezembro	26.973.446,49	1.158.510,78	0,00	28.531.635,46	399.678,19	309.850,88	1,42%	0,97%	1,22%	16,08%	6,02%	3,34%



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

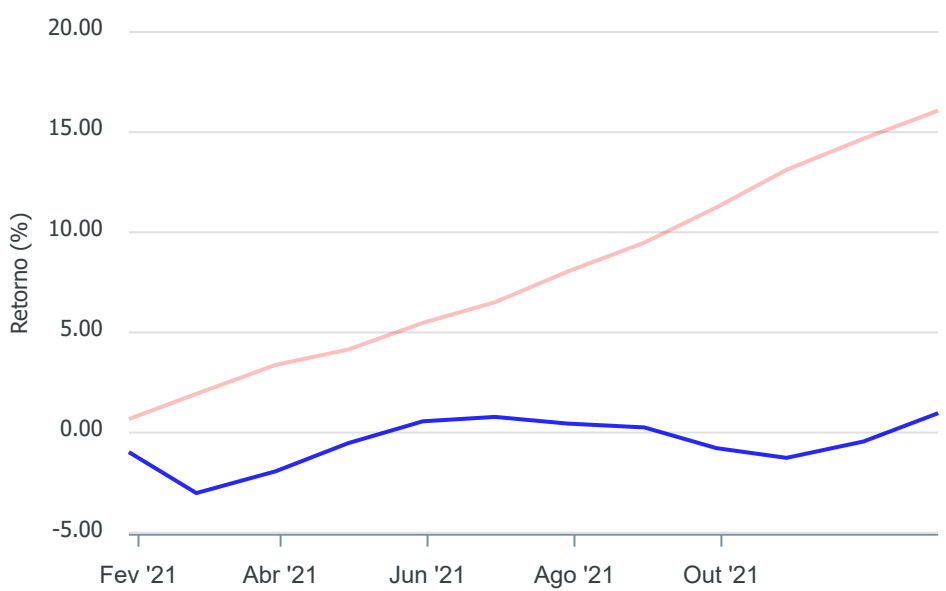
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Dezembro/2021 **FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	867.831,41	0,00	0,00	875.764,26	7.932,85	0,91%	0,91%	1,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	124.771,97	0,00	0,00	125.845,98	1.074,01	0,86%	0,86%	0,23%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.121.594,40	0,00	0,00	3.147.368,95	25.774,55	0,83%	0,83%	0,23%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	963.125,00	189.043,87	0,00	1.161.076,18	8.907,31	0,77%	0,76%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.760.515,54	189.043,87	0,00	2.972.306,06	22.746,65	0,77%	0,77%	1,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.382.529,33	0,00	0,00	2.399.676,66	17.147,33	0,72%	0,72%	1,10%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	464.022,87	0,00	0,00	467.340,08	3.317,21	0,71%	0,71%	1,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.337.630,62	101.220,63	0,00	1.449.075,35	10.224,10	0,71%	0,76%	0,79%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.610.250,05	0,00	0,00	3.635.745,71	25.495,66	0,71%	0,71%	1,05%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	660.817,26	101.220,62	0,00	767.254,86	5.216,98	0,68%	0,75%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	774.303,26	289.928,75	0,00	1.070.718,34	6.486,33	0,61%	0,80%	0,03%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	819.980,04	0,00	0,00	820.675,81	695,77	0,08%	0,08%	2,27%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	288.053,04	0,00	288.257,26	204,22	0,07%	0,75%	0,04%
Total Renda Fixa	**17.887.371,75**	**1.158.510,78**	**0,00**	**19.181.105,50**	**135.222,97**	**0,71%**		**0,83%**

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 Dezembro/2021 **FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.288.467,89	0,00	0,00	1.360.126,17	71.658,28	5,56%	5,56%	7,98%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	920.992,37	0,00	0,00	969.580,73	48.588,36	5,28%	5,28%	7,90%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.845.784,28	0,00	0,00	1.909.258,34	63.474,06	3,44%	3,44%	9,23%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	114.496,41	0,00	0,00	118.042,41	3.546,00	3,10%	3,10%	9,14%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	352.623,27	0,00	0,00	363.400,39	10.777,12	3,06%	3,06%	10,19%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	555.609,83	0,00	0,00	571.522,83	15.913,00	2,86%	2,86%	8,95%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	407.060,07	0,00	0,00	410.043,38	2.983,31	0,73%	0,73%	0,12%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	174.687,18	0,00	0,00	174.646,69	-40,49	-0,02%	-0,02%	10,46%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	380.513,72	0,00	0,00	380.363,23	-150,49	-0,04%	-0,04%	10,38%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	437.648,59	0,00	0,00	436.369,45	-1.279,14	-0,29%	-0,29%	9,02%
Total Renda Variável	**6.477.883,61**	**0,00**	**0,00**	**6.693.353,62**	**215.470,01**	**3,33%**		**8,34%**

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 (Dezembro / 2021) **FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	382.986,13	0,00	0,00	394.083,00	11.096,87	2,90%	2,90%	8,37%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.225.205,00	0,00	0,00	2.263.093,34	37.888,34	1,70%	1,70%	8,95%
Total Exterior	**2.608.191,13**	**0,00**	**0,00**	**2.657.176,34**	**48.985,21**	**1,88%**		**8,87%**

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 4º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.569.345,70	0,00	0,00	3.635.745,71	66.400,01	1,86%	1,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.727.969,29	189.043,87	0,00	2.972.306,06	55.292,90	1,90%	1,97%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.356.776,76	0,00	0,00	2.399.676,66	42.899,90	1,82%	1,82%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.114.160,39	0,00	0,00	3.147.368,95	33.208,56	1,07%	1,07%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	952.015,72	189.043,87	0,00	1.161.076,18	20.016,59	1,75%	1,94%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.329.240,44	101.220,63	0,00	1.449.075,35	18.614,28	1,30%	1,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	561.651,86	495.068,22	75,00	1.070.718,34	14.073,26	1,33%	1,93%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	223.261,85	533.527,43	0,00	767.254,86	10.465,58	1,38%	1,87%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	867.142,55	0,00	0,00	875.764,26	8.621,71	0,99%	0,99%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	459.049,25	0,00	0,00	467.340,08	8.290,83	1,81%	1,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	123.190,40	0,00	0,00	125.845,98	2.655,58	2,16%	2,16%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	414.201,62	405.223,26	0,00	820.675,81	1.250,93	0,15%	0,37%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	288.053,04	0,00	288.257,26	204,22	0,07%	1,89%
			Total Renda Fixa		**281.994,35**	**1,49%**	

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 4º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.202.882,08	0,00	0,00	1.360.126,17	157.244,09	13,07%	13,07%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	863.879,33	0,00	0,00	969.580,73	105.701,40	12,24%	12,24%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	402.728,51	0,00	0,00	410.043,38	7.314,87	1,82%	1,82%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	124.817,94	0,00	0,00	118.042,41	-6.775,53	-5,43%	-5,43%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	378.938,96	0,00	0,00	363.400,39	-15.538,57	-4,10%	-4,10%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	605.374,40	0,00	0,00	571.522,83	-33.851,57	-5,59%	-5,59%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	209.636,17	0,00	0,00	174.646,69	-34.989,48	-16,69%	-16,69%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	500.405,47	0,00	0,00	436.369,45	-64.036,02	-12,80%	-12,80%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	456.464,99	0,00	0,00	380.363,23	-76.101,76	-16,67%	-16,67%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.039.556,68	0,00	0,00	1.909.258,34	-130.298,34	-6,39%	-6,39%
			Total Renda Variável		**-91.330,91**	**-1,35%**	

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 ano de 2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.095.928,60	2.382.004,43	0,00	3.635.745,71	157.812,68	4,54%	4,65%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	809.361,66	1.486.560,21	4.107,25	2.399.676,66	107.862,04	4,70%	4,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	740.333,50	2.144.239,98	0,00	2.972.306,06	87.732,58	3,04%	4,31%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	1.116.329,93	0,00	1.161.076,18	44.746,25	4,01%	4,27%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	74.895,58	970.704,09	2.081,75	1.070.718,34	27.200,42	2,60%	4,62%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	446.753,80	0,00	0,00	467.340,08	20.586,28	4,61%	4,61%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	794.153,00	3.837.392,93	1.503.105,13	3.147.368,95	18.928,15	0,41%	-0,11%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	756.155,94	0,00	767.254,86	11.098,92	1,47%	4,52%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.340.639,43	101.220,63	0,00	1.449.075,35	7.215,29	0,50%	0,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	120.392,79	0,00	0,00	125.845,98	5.453,19	4,53%	4,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.008,29	206.051,05	222.628,51	0,00	569,17	0,26%	2,70%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	288.053,04	0,00	288.257,26	204,22	0,07%	4,60%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	29.795,12	207.122,11	236.639,15	0,00	-278,08	-0,12%	2,64%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	824.143,58	0,00	820.675,81	-3.467,77	-0,42%	-1,47%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	879.267,60	0,00	0,00	875.764,26	-3.503,34	-0,40%	-0,40%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	159.626,60	0,00	155.168,50	0,00	-4.458,10	-2,79%	-2,28%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	611.414,42	0,00	601.188,68	0,00	-10.225,74	-1,67%	0,35%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	786.876,17	0,00	764.956,06	0,00	-21.920,11	-2,79%	-2,18%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	656.760,24	0,00	624.940,40	0,00	-31.819,84	-4,84%	-5,27%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.424.471,71	0,00	1.387.577,08	0,00	-36.894,63	-2,59%	-1,48%

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 ano de 2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	750.888,27	0,00	711.789,86	0,00	-39.098,41	-5,21%	-5,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.581.635,15	0,00	1.536.353,20	0,00	-45.281,95	-2,86%	-1,53%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	911.743,28	0,00	862.089,95	0,00	-49.653,33	-5,45%	-6,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.120.154,02	0,00	1.049.781,02	0,00	-70.373,00	-6,28%	-7,00%
			Total Renda Fixa		**172.434,89**	**0,91%**	

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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	1.115.692,43	0,00	1.360.126,17	244.433,74	21,91%	32,83%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	0,00	841.764,23	0,00	969.580,73	127.816,50	15,18%	30,30%
BB SIDERURGIA FIC AÇÕES	0,00	617.028,29	690.331,27	0,00	73.302,98	11,88%	5,84%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	219.660,42	242.144,30	0,00	22.483,88	10,24%	-9,35%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	400.000,00	0,00	410.043,38	10.043,38	2,51%	4,37%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	135.970,59	0,00	0,00	118.042,41	-17.928,18	-13,19%	-13,19%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	395.684,99	0,00	0,00	363.400,39	-32.284,60	-8,16%	-8,16%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	237.073,81	2.144,30	0,00	174.646,69	-64.571,42	-26,99%	-26,98%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	650.286,66	0,00	0,00	571.522,83	-78.763,83	-12,11%	-12,11%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	648.372,14	0,00	550.193,30	0,00	-98.178,84	-15,14%	-32,03%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	549.619,06	0,00	0,00	436.369,45	-113.249,61	-20,61%	-20,61%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.036.976,22	0,00	898.664,13	0,00	-138.312,09	-13,34%	-32,10%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	1.543.947,25	0,00	1.000.000,00	380.363,23	-163.584,02	-10,60%	-27,27%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.308.135,66	1.259.660,43	400.000,00	1.909.258,34	-258.537,75	-10,07%	-11,53%
			Total Renda Variável		**-487.329,86**	**-6,79%**	

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

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 3.922/2010, 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 3.922 de 25 de novembro de 2010 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