CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2023

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	2.707.820,66	6,59%	657	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.192.722,29	10,21%	953	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.878.555,31	4,57%	784	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	206.608,53	0,50%	199	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.159.472,43	2,82%	1.127	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	832.488,34	2,03%	185	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA P...	D+0	47710	514.309,65	1,25%	118	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	513.593,12	1,25%	301	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.694.177,33	8,99%	775	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.760.451,61	6,72%	921	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.686.504,71	8,98%	934	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	830.226,73	2,02%	714	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	537.739,90	1,31%	39	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	D+0	Não há	875.998,13	2,13%	1.196	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	531.307,50	1,29%	1.120	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.374.269,56	5,78%	1.116	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.215.969,90	2,96%	1.003	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.760.661,28	4,29%	412	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	938.098,14	2,28%	68	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	146.390,52	0,36%	210	0,01%	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

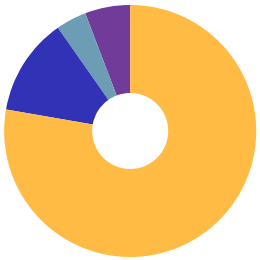
Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

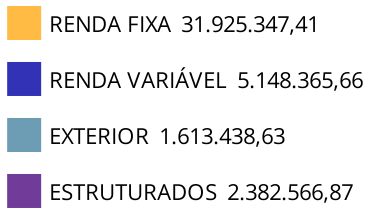
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	567.981,77	1,38%	225	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	173.851,02	0,42%	593	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	929.709,03	2,26%	21.727	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	273.730,84	0,67%	6.045	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.547.150,73	3,77%	1.364	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.273.187,29	3,10%	93	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	126.358,60	0,31%	6.687	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	417.060,13	1,02%	2.453	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	D+3	Não há	407.318,02	0,99%	7.632	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	308.655,55	0,75%	11.912	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.304.783,08	3,18%	494	0,06%	Artigo 9º, Inciso III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	758.882,94	1,85%	202.416	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.344.597,61	3,27%	7.098	0,09%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	279.086,32	0,68%	3.125	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			**41.069.718,57**				

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 (Maio / 2023)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	21,32%	100,00%	41.069.718,57
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	24.390.668,74	59,39%	0,00%	26,32%	100,00%	16.679.049,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	7.534.678,67	18,35%	0,00%	22,47%	60,00%	17.107.152,47
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	8.213.943,71
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.053.485,93
Total Renda Fixa	100,00%	31.925.347,41	77,73%	0,00%	75,11%	285,00%	





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

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5.148.365,66	12,54%	0,00%	13,89%	30,00%	7.172.549,91
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.382.566,87	5,80%	0,00%	5,00%	10,00%	1.724.404,99
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	7.530.932,53	18,34%	0,00%	18,89%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.613.438,63	3,93%	0,00%	5,00%	10,00%	2.493.533,23
Total Exterior	10,00%	1.613.438,63	3,93%	0,00%	5,00%	10,00%	

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 (Maio / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	19.206.657,71	46,77	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.858.226,88	43,48	-
ITAÚ UNIBANCO	2.451.137,83	5,97	0,00
SICREDI	875.998,13	2,13	0,00
BANRISUL CORRETORA	531.307,50	1,29	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	146.390,52	0,36	-

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira $	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	24.390.668,74	59,39	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	7.534.678,67	18,35	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	5.148.365,66	12,54	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	1.613.438,63	3,93	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.382.566,87	5,80	0,00	10,00

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 Maio/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,29%	5,76%	2,60%	7,07%	8,74%	18,79%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	5,49%	2,47%	6,77%	8,61%	18,88%	0,68%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	5,50%	2,49%	6,80%	8,35%	18,22%	0,75%	0,03%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	0,39%	5,57%	2,55%	6,86%	8,40%	18,23%	0,76%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	4,13%	11,16%	11,29%	9,84%	11,30%	11,03%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,12%	10,99%	11,13%	9,67%	10,95%	10,24%	2,42%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,14%	5,42%	3,26%	6,67%	13,53%	20,82%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	5,27%	3,18%	6,49%	13,21%	20,16%	0,09%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,57%	5,93%	3,02%	6,92%	9,45%	19,90%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,61%	5,90%	3,02%	6,87%	9,27%	19,31%	0,68%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	5,91%	3,04%	6,89%	9,41%	19,60%	0,63%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,53%	8,76%	7,39%	8,55%	10,47%	15,54%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2,76%	8,93%	7,70%	8,66%	9,01%	14,13%	1,64%	0,05%
Selic (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	1,13%	5,19%	3,11%	6,32%	13,08%	21,80%	0,03%	0,00%

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 Maio/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,15%	5,29%	3,24%	6,47%	13,47%	22,81%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,18%	5,25%	3,28%	6,46%	13,49%	22,99%	0,03%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,24%	5,29%	3,32%	6,47%	13,49%	23,07%	0,04%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	5,36%	3,24%	6,51%	13,40%	22,55%	0,06%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,49%	5,73%	3,75%	6,94%	12,68%	24,34%	0,26%	0,01%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	1,16%	5,34%	3,22%	6,50%	13,42%	22,46%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,23%	2,95%	1,56%	3,59%	3,94%	16,13%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,88%	6,83%	5,12%	7,65%	12,47%	17,91%	0,69%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,84%	9,38%	7,68%	9,29%	-	-	1,79%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,54%	8,18%	5,11%	8,52%	-	-	1,16%	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,01%	1,56%	1,78%	2,89%	1,43%	4,52%	0,51%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,81%	6,03%	3,94%	7,24%	12,48%	16,41%	0,56%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,35%	7,88%	6,13%	7,48%	11,36%	20,73%	1,00%	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 Maio/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,14%	5,12%	3,27%	6,18%	12,45%	21,05%	0,12%	0,00%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1,36%	5,28%	3,28%	6,50%	13,45%	23,47%	0,18%	0,01%
Global BDRX (Benchmark)	5,90%	14,58%	8,54%	9,75%	14,79%	-0,17%	-	-
Ibovespa (Benchmark)	3,74%	-1,28%	3,24%	-3,69%	-2,71%	-14,17%	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	12,47%	-1,87%	5,60%	-7,05%	-17,58%	-48,81%	9,58%	0,31%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	4,08%	-2,17%	2,33%	-4,74%	-5,17%	-18,12%	8,38%	0,20%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3,29%	-1,67%	1,69%	-4,34%	-4,55%	-16,42%	8,56%	0,18%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	3,58%	-1,45%	3,06%	-3,70%	-2,56%	-14,15%	7,96%	0,19%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5,75%	8,57%	12,93%	3,48%	4,33%	2,28%	6,54%	0,24%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	11,99%	-1,81%	6,06%	-6,99%	-16,97%	-48,29%	9,27%	0,31%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	4,65%	-3,17%	2,12%	-7,05%	-10,16%	-27,81%	8,31%	0,23%
MSCI ACWI (Benchmark)	0,56%	4,28%	0,55%	-1,39%	6,70%	-11,51%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1,21%	12,31%	7,30%	6,81%	10,60%	16,12%	6,05%	0,22%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	2,12%	5,72%	2,36%	-2,22%	7,87%	-6,83%	-	-

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 e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	0,25%	8,86%	5,28%	2,44%	1,15%	-0,58%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1,33%	10,63%	6,19%	5,56%	7,99%	11,26%	5,42%	0,20%

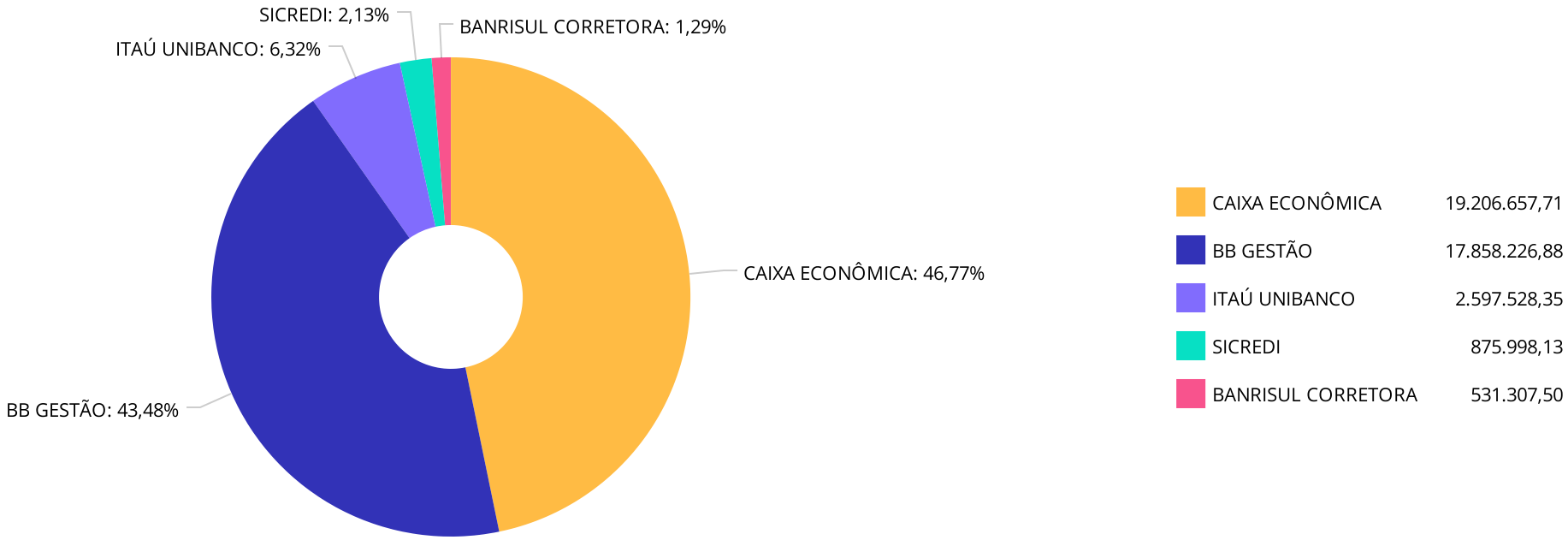
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	2,12%	5,72%	2,36%	-2,22%	7,87%	-6,83%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3,04%	5,69%	3,42%	0,54%	7,86%	-6,37%	6,35%	15,073%
Global BDRX (Benchmark)	5,90%	14,58%	8,54%	9,75%	14,79%	-0,17%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,80%	14,00%	8,47%	8,53%	13,81%	-3,05%	8,28%	16,769%

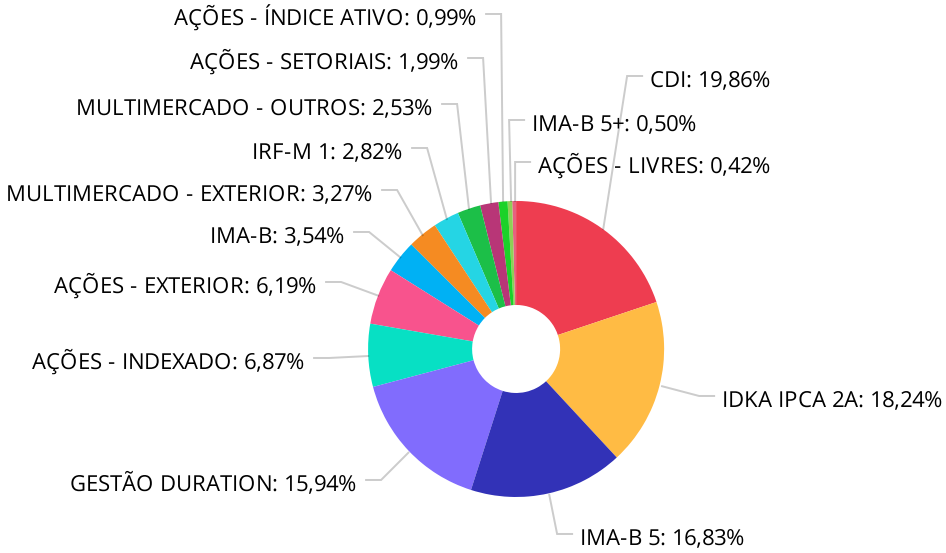
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Maio / 2023)



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 (Maio / 2023)

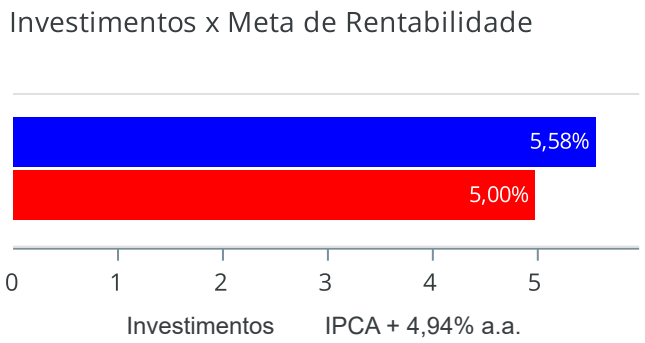


CDI	8.156.414,87	IDKA IPCA 2A	7.490.913,80	IMA-B 5	6.911.141,48	GESTÃO DURATION	6.548.388,51
AÇÕES - INDEXADO	2.820.338,02	AÇÕES - EXTERIOR	2.543.147,66	IMA-B	1.452.407,79	MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.344.597,61
IRF-M 1	1.159.472,43	MULTIMERCADO - OUTROS	1.037.969,26	AÇÕES - SETORIAIS	817.149,57	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	407.318,02
IMA-B 5+	206.608,53	AÇÕES - LIVRES	173.851,02				

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 e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	36.382.479,85	0,00	51.200,50	36.988.803,65	657.524,30	657.524,30	1,81%	1,81%	0,95%	0,95%	189,42%	2,73%
Fevereiro	36.988.803,65	569.541,96	62.408,07	37.456.650,70	-39.286,84	618.237,46	-0,10%	1,70%	1,19%	2,15%	78,97%	2,49%
Março	37.456.650,70	1.439.532,34	0,00	39.322.401,32	426.218,28	1.044.455,74	1,10%	2,82%	1,15%	3,33%	84,47%	2,26%
Abril	39.322.401,32	0,00	330.000,00	39.396.806,44	404.405,12	1.448.860,86	1,03%	3,87%	0,96%	4,32%	89,61%	2,06%
Maio	39.396.806,44	1.456.922,78	449.420,21	41.069.718,57	665.409,56	2.114.270,42	1,65%	5,58%	0,65%	5,00%	111,61%	1,91%

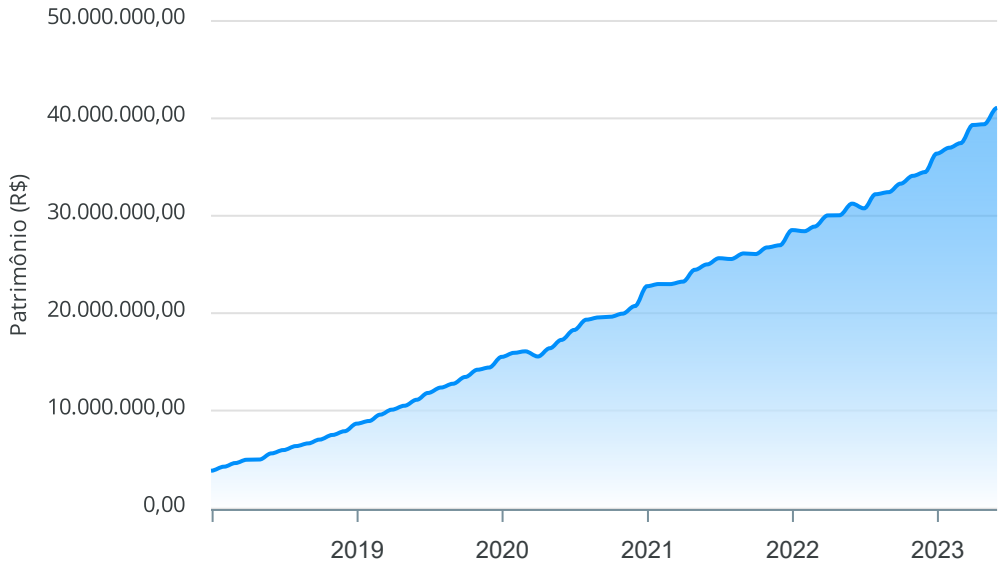


Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

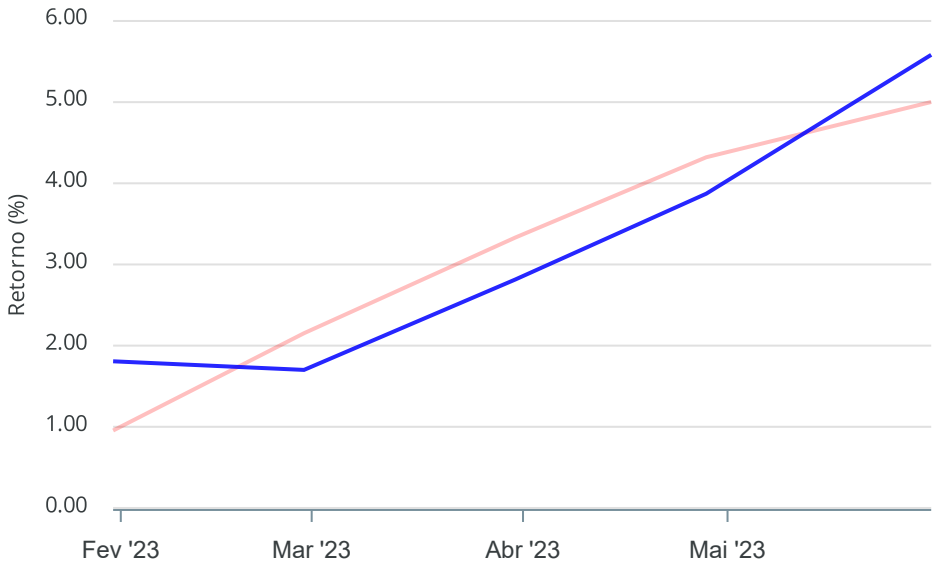
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO | 36M

Evolução do Patrimônio



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 Maio/2023 **FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	198.436,73	0,00	0,00	206.608,53	8.171,80	4,12%	4,12%	2,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	500.000,00	0,00	514.309,65	14.309,65	2,86%	2,84%	1,79%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	912.864,51	0,00	0,00	938.098,14	25.233,63	2,76%	2,76%	1,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	143.026,58	0,00	0,00	146.390,52	3.363,94	2,35%	2,35%	1,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.657.743,83	0,00	0,00	2.707.820,66	50.076,83	1,88%	1,88%	0,69%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.628.677,76	0,00	0,00	3.694.177,33	65.499,57	1,81%	1,81%	0,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	559.618,92	0,00	0,00	567.981,77	8.362,85	1,49%	1,49%	0,26%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1.739.075,73	0,00	0,00	1.760.661,28	21.585,55	1,24%	1,24%	0,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	566.566,74	253.751,28	0,00	830.226,73	9.908,71	1,21%	1,22%	0,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.201.788,40	0,00	0,00	1.215.969,90	14.181,50	1,18%	1,18%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.347.253,94	0,00	0,00	2.374.269,56	27.015,62	1,15%	1,15%	0,02%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL DI FI RENDA FIXA	612.356,37	253.751,29	0,00	875.998,13	9.890,47	1,14%	1,16%	0,03%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	525.367,19	0,00	0,00	531.307,50	5.940,31	1,13%	1,13%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.146.612,67	0,00	0,00	1.159.472,43	12.859,76	1,12%	1,12%	0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	386.375,56	449.420,21	10.679,59	832.488,34	7.372,16	0,88%	1,54%	1,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	435.962,38	0,00	438.740,62	0,00	2.778,24	0,64%	1,19%	0,13%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.663.405,08	0,00	0,00	3.686.504,71	23.099,63	0,63%	0,63%	0,63%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.867.148,24	0,00	0,00	1.878.555,31	11.407,07	0,61%	0,61%	0,68%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	535.657,21	0,00	0,00	537.739,90	2.082,69	0,39%	0,39%	0,76%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.176.483,86	0,00	0,00	4.192.722,29	16.238,43	0,39%	0,39%	0,68%

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 Maio/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.750.537,94	0,00	0,00	2.760.451,61	9.913,67	0,36%	0,36%	0,75%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	513.640,94	0,00	0,00	513.593,12	-47,82	-0,01%	-0,01%	0,51%
Total Renda Fixa	**30.568.600,58**	**1.456.922,78**	**449.420,21**	**31.925.347,41**	**349.244,26**	**1,11%**		**0,55%**

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 Maio/2023 **FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB CONSUMO FIC AÇÕES	243.383,45	0,00	0,00	273.730,84	30.347,39	12,47%	12,47%	9,58%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	112.830,21	0,00	0,00	126.358,60	13.528,39	11,99%	11,99%	9,27%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	394.368,84	0,00	0,00	417.060,13	22.691,29	5,75%	5,75%	6,54%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	389.211,58	0,00	0,00	407.318,02	18.106,44	4,65%	4,65%	8,31%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	1.486.545,06	0,00	0,00	1.547.150,73	60.605,67	4,08%	4,08%	8,38%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.229.133,85	0,00	0,00	1.273.187,29	44.053,44	3,58%	3,58%	7,96%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	168.317,26	0,00	0,00	173.851,02	5.533,76	3,29%	3,29%	8,56%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	275.352,23	0,00	0,00	279.086,32	3.734,09	1,36%	1,36%	0,18%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	917.471,58	0,00	0,00	929.709,03	12.237,45	1,33%	1,33%	5,42%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.328.501,03	0,00	0,00	1.344.597,61	16.096,58	1,21%	1,21%	6,05%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	750.338,77	0,00	0,00	758.882,94	8.544,17	1,14%	1,14%	0,12%
Total Renda Variável	**7.295.453,86**	**0,00**	**0,00**	**7.530.932,53**	**235.478,67**	**3,23%**		**6,35%**

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 mês de (Maio / 2023)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.233.196,84	0,00	0,00	1.304.783,08	71.586,24	5,80%	5,80%	8,28%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	299.555,16	0,00	0,00	308.655,55	9.100,39	3,04%	3,04%	6,35%
Total Exterior	**1.532.752,00**	**0,00**	**0,00**	**1.613.438,63**	**80.686,63**	**5,26%**		**7,91%**

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 CRÉDITO & MERCADO. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: https://www.gov.br/cvm/pt-br.

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

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º 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 MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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