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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.730.740,01	1,20%	1.071	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.895.977,47	2,01%	318	0,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	175.313,71	0,04%	1.063	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	77.146.911,87	19,60%	1.172	1,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	4.939.625,40	1,25%	82	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.712,52	0,00%	872	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	75.669.977,46	19,22%	973	0,53%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.076.799,24	0,78%	271	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	6.011.073,61	1,53%	199	3,79%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	60.977.476,74	15,49%	473	2,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO P...	D+21	Não há	7.562.551,01	1,92%	1.160	0,89%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1	Não há	11.025.042,74	2,80%	6.767	0,94%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.624.046,90	1,94%	4.250	0,47%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	13.086.467,02	3,32%	1.967	1,21%	Artigo 8º, Inciso I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.957.690,12	1,01%	25.205	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.993.087,84	1,01%	646	1,92%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	8.784.182,85	2,23%	31	0,85%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	5.480.368,26	1,39%	2.067	0,52%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	14.450.580,01	3,67%	2.928	4,21%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	7.414.390,14	1,88%	46	0,61%	Artigo 8º, Inciso I

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

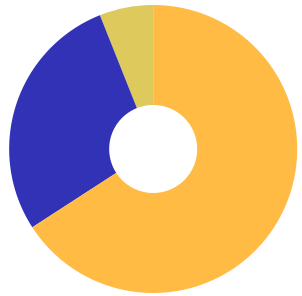
Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.126.781,67	1,56%	187	3,59%	Artigo 8º, Inciso I
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	4.952.809,97	1,26%	2.757	0,43%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	879.874,99	0,22%	61	0,14%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	2.175.401,54	0,55%	71	1,83%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	5.860.838,53	1,49%	9.161	0,95%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	8.697.526,24	2,21%	671	0,68%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	6.136.172,07	1,56%	99.225	0,35%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	6.967.037,19	1,77%	34.500	0,80%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	7.083.186,58	1,80%	3.069	1,70%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	11.572.547,32	2,94%	525	2,11%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	9.179.485,43	2,33%	35.991	0,75%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			**393.636.676,45**				

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	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	13,00%	50,00%	196.818.338,23
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	94.888.568,46	24,11%	20,00%	34,00%	80,00%	220.020.772,70
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	11.809.100,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	145.738.039,57	37,02%	10,00%	15,00%	60,00%	90.443.966,30
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	39.363.667,65
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	18.587.593,75	4,72%	0,00%	5,00%	5,00%	1.094.240,07
Total Renda Fixa	100,00%	259.214.201,78	65,85%	30,00%	67,00%	208,00%	



RENDA FIXA 259.214.201,78

RENDA VARIÁVEL 110.672.661,30

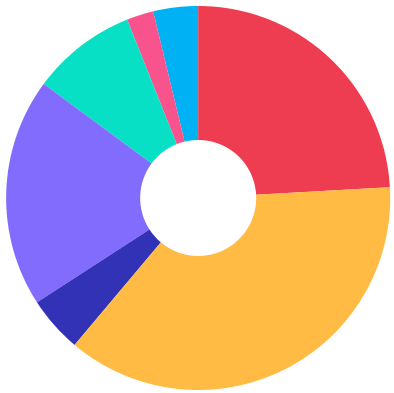
EXTERIOR 23.749.813,37

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	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	75.870.404,78	19,27%	10,00%	18,00%	30,00%	42.220.598,16
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	34.802.256,52	8,84%	3,00%	9,00%	10,00%	4.561.411,13
Total Renda Variável	30,00%	110.672.661,30	28,12%	13,00%	27,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	8.916.115,06	2,27%	3,00%	3,00%	10,00%	30.447.552,59
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	14.833.698,31	3,77%	4,00%	6,00%	10,00%	24.529.969,34
Total Exterior	10,00%	23.749.813,37	6,03%	7,00%	9,00%	20,00%	



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

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	163.964.979,75	41,65	0,58
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	60.977.476,74	15,49	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	22.657.484,66	5,76	-
WESTERN ASSET	15.315.657,50	3,89	0,03
SOMMA INVESTIMENTOS	14.450.580,01	3,67	-
TARPON INVESTIMENTOS	13.541.171,81	3,44	0,19
SAFRA ASSET MANAGEMENT	11.572.547,32	2,94	0,01
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	11.025.042,74	2,80	0,10
GUEPARDO INVESTIMENTOS	8.784.182,85	2,23	0,27
BANCO J. SAFRA S/A	8.697.526,24	2,21	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	7.624.046,90	1,94	0,02
ICATU VANGUARDA	7.562.551,01	1,92	0,01
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	7.083.186,58	1,80	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	6.967.037,19	1,77	0,00
PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	6.011.073,61	1,53	-
XP ASSET MANAGEMENT	5.860.838,53	1,49	0,03
OCCAM BRASIL	5.480.368,26	1,39	0,03
TRUXT INVESTIMENTOS	4.952.809,97	1,26	0,02
ITAÚ UNIBANCO	4.939.625,40	1,25	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.993.087,84	1,01	0,01
GENIAL INVESTIMENTOS	2.175.401,54	0,55	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira $	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	94.888.568,46	24,11	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	145.738.039,57	37,02	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	18.587.593,75	4,72	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	75.870.404,78	19,27	10,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	8.916.115,06	2,27	2,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	14.833.698,31	3,77	4,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	34.802.256,52	8,84	3,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,36%	6,28%	-0,07%	4,90%	9,42%	14,98%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,05%	6,17%	0,00%	4,95%	9,27%	14,82%	1,44%	0,04%
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%	-	-
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,83%	7,50%	1,18%	6,47%	10,15%	16,86%	1,51%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,23%	7,40%	3,25%	5,94%	9,04%	11,48%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,21%	7,22%	3,19%	5,81%	8,80%	10,97%	0,11%	0,02%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,00%	6,62%	0,35%	5,38%	9,88%	15,12%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	-0,01%	6,51%	0,31%	5,30%	9,69%	14,64%	1,31%	0,04%
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC RENDA FIXA LP	0,13%	6,38%	0,36%	5,25%	9,61%	15,15%	1,50%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,20%	8,06%	3,30%	6,22%	10,64%	13,69%	0,02%	0,01%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,21%	8,09%	3,35%	6,36%	10,86%	14,26%	0,01%	0,01%
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,27%	8,48%	3,49%	6,68%	11,43%	17,24%	0,03%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,08%	7,01%	2,99%	5,60%	9,08%	10,75%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,19%	7,93%	3,29%	6,21%	10,55%	13,60%	0,01%	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 Agosto/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1,02%	6,61%	2,83%	5,30%	8,56%	10,50%	0,00%	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 Agosto/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-3,14%	-11,92%	-1,60%	-5,07%	-4,92%	25,53%	9,02%	0,21%
Ibovespa (Benchmark)	6,16%	4,48%	-1,64%	-3,20%	-7,79%	10,22%	-	-
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	6,87%	1,36%	-3,69%	-4,60%	-11,49%	2,81%	9,70%	0,23%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	10,15%	16,52%	8,26%	9,52%	16,64%	61,12%	9,61%	0,24%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11,23%	8,76%	2,93%	7,67%	7,92%	-	9,27%	0,30%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,77%	-0,18%	-3,54%	-3,37%	-5,17%	19,86%	9,11%	0,20%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,85%	5,93%	2,18%	0,68%	-15,08%	1,15%	8,39%	0,22%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	7,85%	5,70%	1,69%	-4,84%	2,77%	21,54%	11,02%	0,28%
OCCAM FIC AÇÕES	7,11%	6,31%	0,88%	-1,24%	-5,22%	7,40%	8,78%	0,20%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6,36%	8,49%	-1,88%	-0,64%	-5,70%	6,65%	8,85%	0,23%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,73%	2,04%	-4,04%	-3,86%	-5,07%	16,50%	9,10%	0,21%
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%
CDI (Benchmark)	1,17%	7,74%	3,25%	6,16%	10,20%	13,18%	-	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,40%	9,43%	3,51%	7,46%	10,97%	13,28%	0,28%	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
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	-3,26%	-12,53%	-1,88%	-5,50%	-5,89%	22,69%	9,01%	0,21%

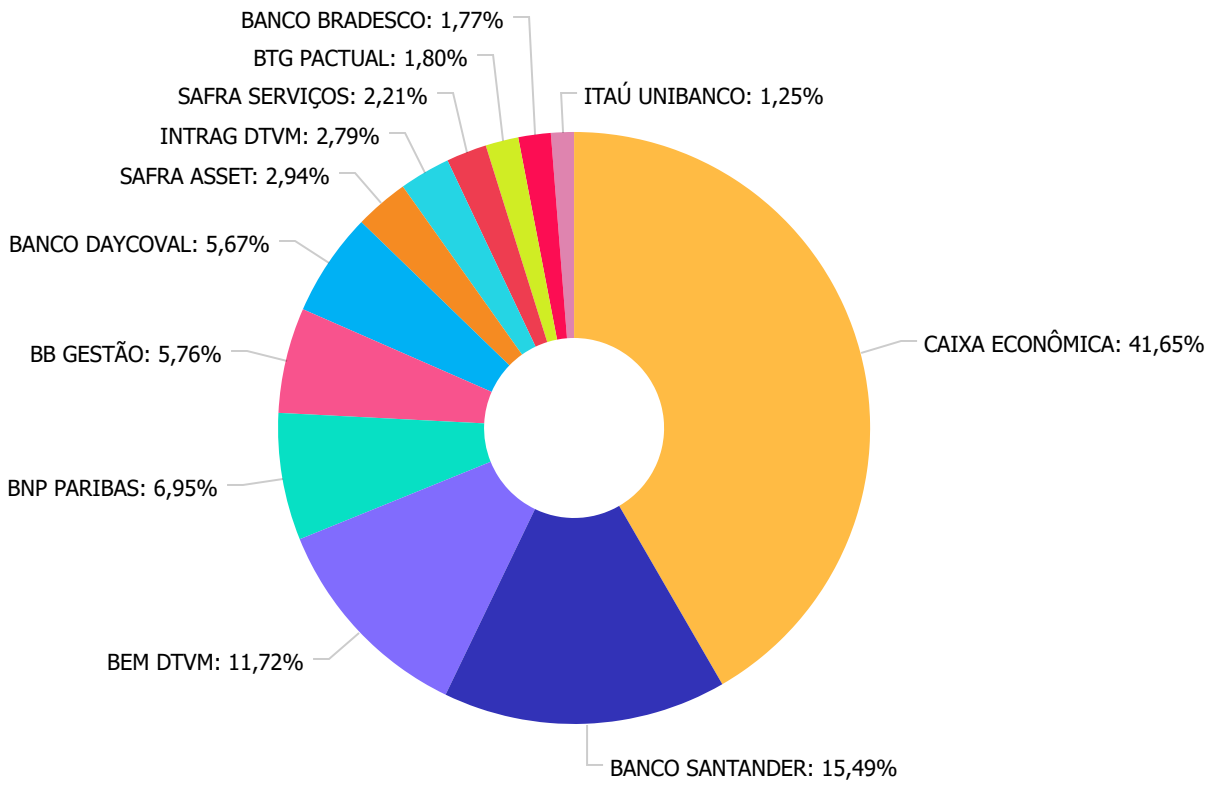
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

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
Global BDRX (Benchmark)	-3,05%	-24,45%	5,20%	-10,08%	-15,31%	0,66%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,46%	-33,57%	6,72%	-15,34%	-26,60%	-15,12%	12,24%	0,26%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,41%	-28,08%	3,90%	-12,14%	-19,74%	-4,88%	11,01%	0,21%
MSCI WORLD (Benchmark)	-4,51%	-24,55%	3,09%	-11,16%	-15,78%	1,28%	-	-
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%
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%
MSCI ACWI (Benchmark)	-4,03%	-24,62%	2,86%	-11,55%	-16,72%	-0,77%	-	-
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-3,72%	-21,89%	5,04%	-6,75%	-10,60%	-	11,53%	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

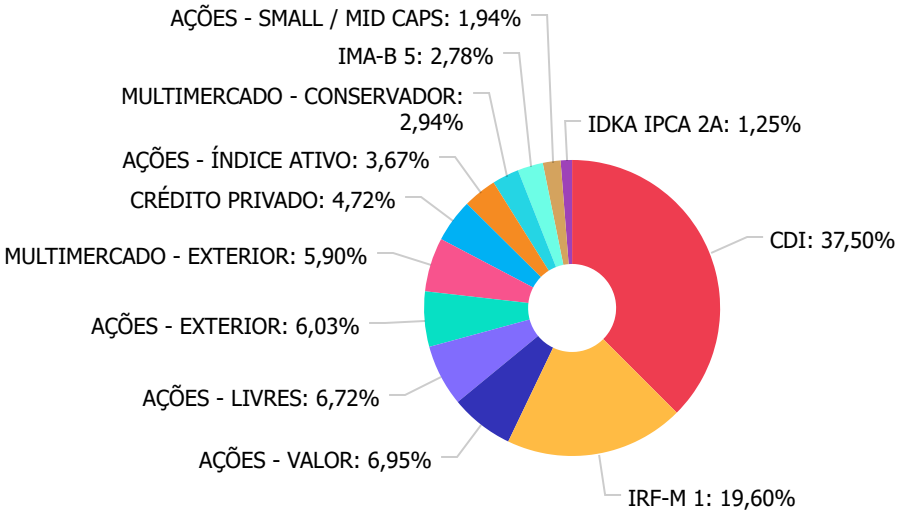
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2022)



CAIXA ECONÔMICA	163.964.979,75
BANCO SANTANDER	60.977.476,74
BEM DTVM	46.142.588,92
BNP PARIBAS	27.344.985,41
BB GESTÃO	22.657.484,66
BANCO DAYCOVAL	22.325.354,66
SAFRA ASSET	11.572.547,32
INTRAG DTVM	10.963.883,58
SAFRA SERVIÇOS	8.697.526,24
BTG PACTUAL	7.083.186,58
BANCO BRADESCO	6.967.037,19
ITAÚ UNIBANCO	4.939.625,40

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)

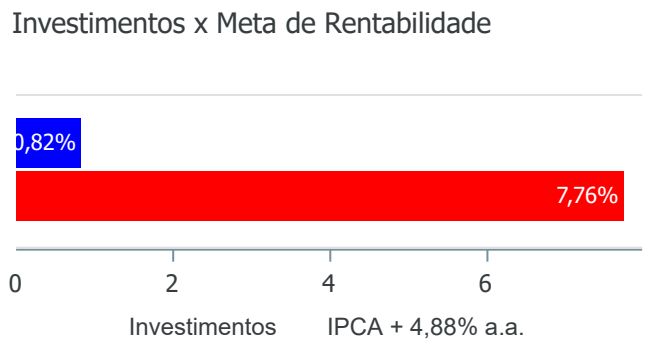


CDI	147.622.943,43	IRF-M 1	77.146.911,87	AÇÕES - VALOR	27.351.018,13
AÇÕES - LIVRES	26.444.759,74	AÇÕES - EXTERIOR	23.749.813,37	MULTIMERCADO - EXTERIOR	23.229.709,20
CRÉDITO PRIVADO	18.587.593,75	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	14.450.580,01	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	11.572.547,32
IMA-B 5	10.950.699,01	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	7.624.046,90	IDKA IPCA 2A	4.906.053,72

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	374.430.502,58	153.659.829,25	152.490.900,46	373.817.254,13	-1.782.177,24	-1.782.177,24	-0,47%	-0,47%	0,94%	0,94%	-50,48%	3,89%
Fevereiro	373.817.254,13	24.706.537,16	21.173.345,95	375.852.318,75	-1.498.126,59	-3.280.303,83	-0,40%	-0,87%	1,37%	2,33%	-37,38%	3,67%
Março	375.852.318,75	57.806.868,57	55.702.797,04	384.461.325,21	6.504.934,93	3.224.631,10	1,72%	0,84%	2,04%	4,42%	18,94%	4,42%
Abril	384.461.325,21	5.129.998,19	5.767.531,21	374.138.871,26	-9.684.920,93	-6.460.289,83	-2,52%	-1,70%	1,42%	5,90%	-28,86%	3,88%
Maio	374.138.871,26	72.354.309,99	66.936.413,63	382.546.343,93	2.989.576,31	-3.470.713,52	0,79%	-0,93%	0,89%	6,85%	-13,58%	4,25%
Junho	382.546.343,93	16.504.457,81	15.099.441,64	374.153.574,38	-9.797.785,72	-13.268.499,24	-2,55%	-3,46%	1,07%	7,99%	-43,28%	4,00%
Julho	374.153.574,38	17.766.585,66	16.361.803,02	385.940.262,04	10.381.905,02	-2.886.594,22	2,76%	-0,79%	-0,28%	7,68%	-10,27%	3,33%
Agosto	385.940.262,04	64.022.824,42	62.606.526,81	393.636.676,45	6.280.116,80	3.393.522,58	1,62%	0,82%	0,07%	7,76%	10,56%	3,22%

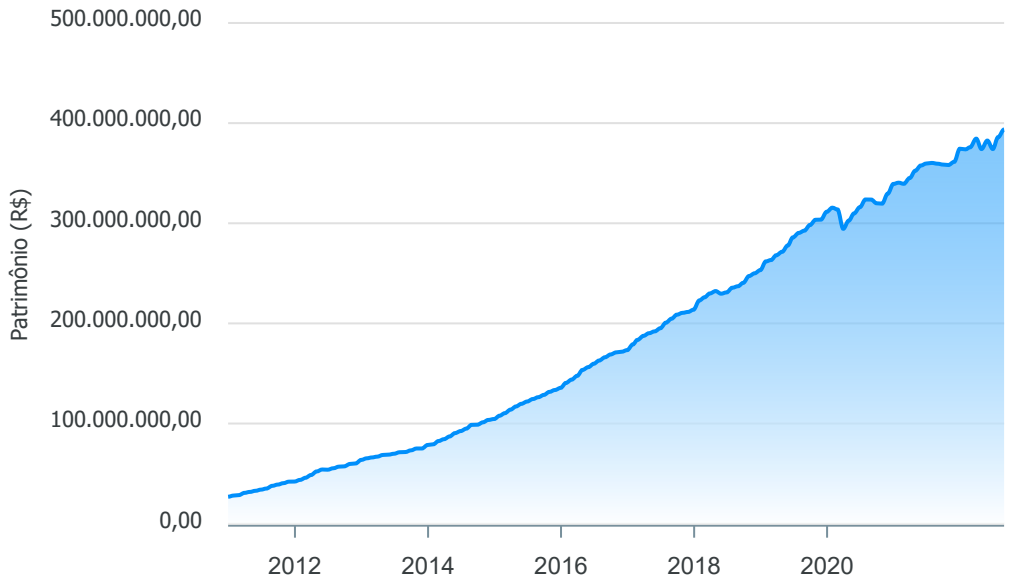


Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

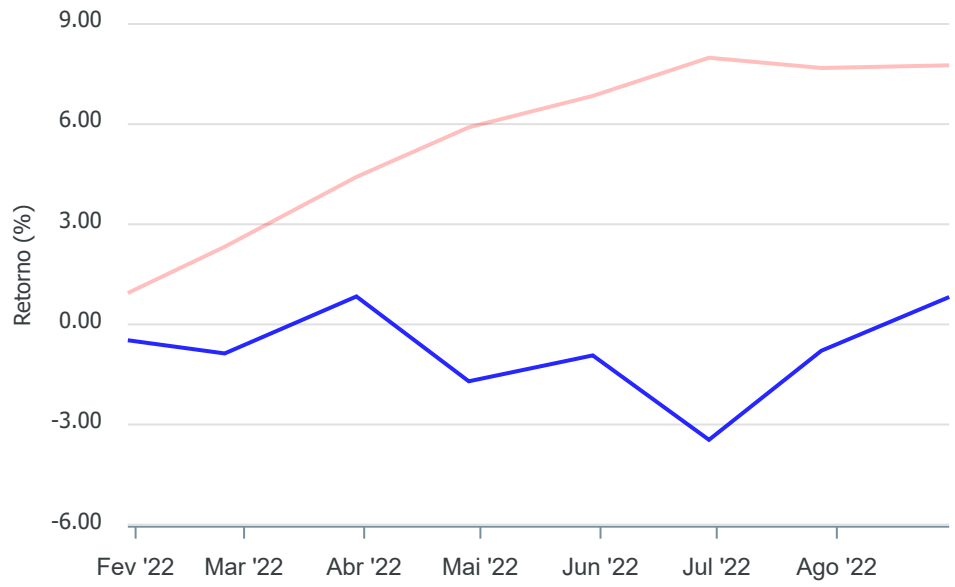
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	10.886.868,53	0,00	0,00	11.025.042,74	138.174,21	1,27%	1,27%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	76.224.070,36	0,00	0,00	77.146.911,87	922.841,51	1,21%	1,21%	0,11%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.040.325,70	0,00	0,00	3.076.799,24	36.473,54	1,20%	1,20%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	74.782.136,37	0,00	0,00	75.669.977,46	887.841,09	1,19%	1,19%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.009,04	1.678,52	3,30	2.712,52	28,26	1,05%	1,08%	0,01%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI...	7.500.205,26	0,00	0,00	7.562.551,01	62.345,75	0,83%	0,83%	1,51%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	20.586.035,24	0,00	20.733.553,22	0,00	147.517,98	0,72%	-0,01%	1,31%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	6.418.390,32	3.287.592,68	1.872.970,29	7.895.977,47	62.964,76	0,65%	1,02%	0,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	0,00	60.733.553,22	0,00	60.977.476,74	243.923,52	0,40%	1,21%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	19.881.160,96	0,00	15.000.000,00	4.939.625,40	58.464,44	0,29%	0,00%	1,31%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	29.676.925,10	0,00	25.000.000,00	4.730.740,01	53.814,91	0,18%	-0,04%	1,44%
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC RENDA FIXA LP	6.003.098,93	0,00	0,00	6.011.073,61	7.974,68	0,13%	0,13%	1,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	175.504,57	0,00	0,00	175.313,71	-190,86	-0,11%	-0,11%	1,43%
Total Renda Fixa	**255.175.730,38**	**64.022.824,42**	**62.606.526,81**	**259.214.201,78**	**2.622.173,79**	**1,02%**		**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

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
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.897.647,50	0,00	0,00	8.784.182,85	886.535,35	11,23%	11,23%	9,27%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	6.731.486,48	0,00	0,00	7.414.390,14	682.903,66	10,14%	10,14%	9,61%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	5.680.907,73	0,00	0,00	6.126.781,67	445.873,94	7,85%	7,85%	11,02%
OCCAM FIC AÇÕES	5.116.759,51	0,00	0,00	5.480.368,26	363.608,75	7,11%	7,11%	8,78%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	13.522.066,32	0,00	0,00	14.450.580,01	928.513,69	6,87%	6,87%	9,70%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.754.344,32	0,00	0,00	3.993.087,84	238.743,52	6,36%	6,36%	8,85%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	7.194.312,12	0,00	0,00	7.624.046,90	429.734,78	5,97%	5,97%	8,25%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.679.147,78	0,00	0,00	4.952.809,97	273.662,19	5,85%	5,85%	8,39%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.743.294,28	0,00	0,00	3.957.690,12	214.395,84	5,73%	5,73%	9,10%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	12.491.092,23	0,00	0,00	13.086.467,02	595.374,79	4,77%	4,77%	9,11%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.412.411,30	0,00	0,00	11.572.547,32	160.136,02	1,40%	1,40%	0,28%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7.312.439,81	0,00	0,00	7.083.186,58	-229.253,23	-3,14%	-3,14%	9,02%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9.484.415,02	0,00	0,00	9.179.485,43	-304.929,59	-3,22%	-3,22%	8,99%
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	7.202.046,21	0,00	0,00	6.967.037,19	-235.009,02	-3,26%	-3,26%	9,01%
Total Renda Variável	**106.222.370,61**	**0,00**	**0,00**	**110.672.661,30**	**4.450.290,69**	**4,19%**		**8,28%**

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...	5.860.538,53	0,00	0,00	5.860.838,53	300,00	0,01%	0,43%	17,52%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	900.398,65	0,00	0,00	879.874,99	-20.523,66	-2,28%	-2,28%	11,00%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.259.454,53	0,00	0,00	2.175.401,54	-84.052,99	-3,72%	-3,72%	11,53%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.098.946,90	0,00	0,00	8.697.526,24	-401.420,66	-4,41%	-4,41%	11,01%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.422.822,44	0,00	0,00	6.136.172,07	-286.650,37	-4,46%	-4,46%	12,24%
Total Exterior	**24.542.161,05**	**0,00**	**0,00**	**23.749.813,37**	**-792.347,68**	**-3,23%**		**12,98%**

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