CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2023

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	6.421.375,93	4,11%	783	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	10.507.372,90	6,72%	1.136	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	Não há	4.030.464,43	2,58%	280	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.908.121,04	9,54%	234	2,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	27.745.414,88	17,76%	773	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	22.810.396,14	14,60%	927	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	661.602,88	0,42%	723	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	268.696,63	0,17%	1.186	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	989.951,84	0,63%	218	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.378.646,74	1,52%	164	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	1.540.520,28	0,99%	13	0,65%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.469.711,67	3,50%	139	0,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.099.050,05	0,70%	82	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.397.156,17	2,17%	360	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	7.075.324,18	4,53%	230	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	24.508.971,46	15,69%	118	3,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.102.364,14	1,99%	490	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.272.470,64	1,45%	1.074	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.192.281,16	1,40%	5.984	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.629.541,18	2,32%	491	0,18%	Artigo 9º, Inciso III

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

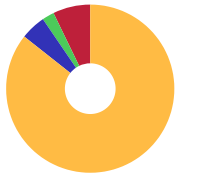
Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

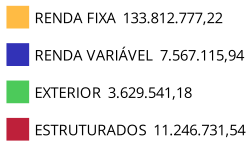
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	5.246.107,11	3,36%	117	0,81%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.000.624,43	3,84%	5.795	1,05%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		435.712,51	0,28%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			**156.256.165,88**				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			**435.712,51**				Artigo 6º
PL Total			**156.691.878,39**				

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 (Junho / 2023)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	87.353.444,83	55,90%	20,00%	30,00%	90,00%	53.277.104,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	46.459.332,39	29,73%	5,00%	30,00%	60,00%	47.294.367,14
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	9,00%	10,00%	15.625.616,59
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.812.808,29
Total Renda Fixa	100,00%	133.812.777,22	85,64%	25,00%	69,00%	165,00%	



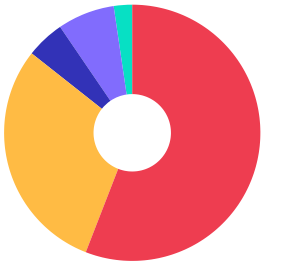


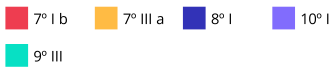
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	7.567.115,94	4,84%	2,00%	18,50%	20,00%	23.684.117,24
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	11.246.731,54	7,20%	3,00%	7,50%	10,00%	4.378.885,05
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.812.808,29
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	5,00%	7.812.808,29
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	18.813.847,48	12,04%	5,00%	30,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.629.541,18	2,32%	0,00%	1,00%	10,00%	11.996.075,41
Total Exterior	10,00%	3.629.541,18	2,32%	0,00%	1,00%	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 (Junho / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	102.411.430,69	65,54	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	29.516.923,35	18,89	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.327.811,84	15,57	-

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 ' b '	87.353.444,83	55,90	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	46.459.332,39	29,73	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	7.567.115,94	4,84	2,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	3.629.541,18	2,32	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	11.246.731,54	7,20	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
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 Junho/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral (Benchmark)	1,74%	8,64%	4,83%	8,64%	14,01%	20,10%	-	-
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	2,66%	11,80%	7,76%	11,80%	13,49%	15,29%	2,50%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,19%	6,68%	3,22%	6,68%	13,82%	22,00%	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	6,57%	3,17%	6,57%	13,59%	21,54%	0,10%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	6,49%	3,14%	6,49%	13,48%	21,33%	0,10%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	6,59%	3,15%	6,59%	13,58%	21,47%	0,11%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	7,00%	2,57%	7,00%	10,18%	21,01%	0,88%	0,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,03%	6,94%	2,52%	6,94%	9,94%	20,35%	0,90%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,03%	6,99%	2,56%	6,99%	10,05%	20,76%	0,90%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,35%	11,24%	7,06%	11,24%	13,32%	17,31%	2,12%	0,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,38%	11,47%	7,19%	11,47%	13,33%	16,94%	2,19%	0,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,39%	11,31%	7,20%	11,31%	13,23%	17,29%	2,17%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	1,05%	6,38%	3,09%	6,38%	13,28%	22,83%	0,00%	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 Junho/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	6,53%	3,22%	6,53%	13,88%	24,53%	0,02%	0,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,12%	5,95%	3,19%	5,95%	13,13%	23,41%	0,01%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,11%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,69%	7,76%	4,31%	7,76%	13,75%	19,35%	0,56%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	-	-	-	-	-	0,47%	-

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 Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,81%	5,35%	4,29%	5,35%	14,58%	18,67%	1,60%	0,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,64%	6,01%	5,71%	6,01%	14,89%	15,14%	2,12%	0,05%
Global BDRX (Benchmark)	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,47%	14,53%	5,60%	14,53%	13,40%	-1,43%	6,60%	0,17%
Ibovespa (Benchmark)	9,00%	7,61%	15,91%	7,61%	19,83%	-6,87%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	8,89%	8,06%	17,13%	8,06%	15,45%	-16,81%	7,53%	0,21%
SMLL (Benchmark)	8,17%	13,26%	25,16%	13,26%	19,79%	-27,64%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	8,03%	13,04%	24,57%	13,04%	18,85%	-28,83%	10,00%	0,27%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	6,48%	4,22%	15,83%	4,22%	9,72%	-24,07%	9,10%	0,24%

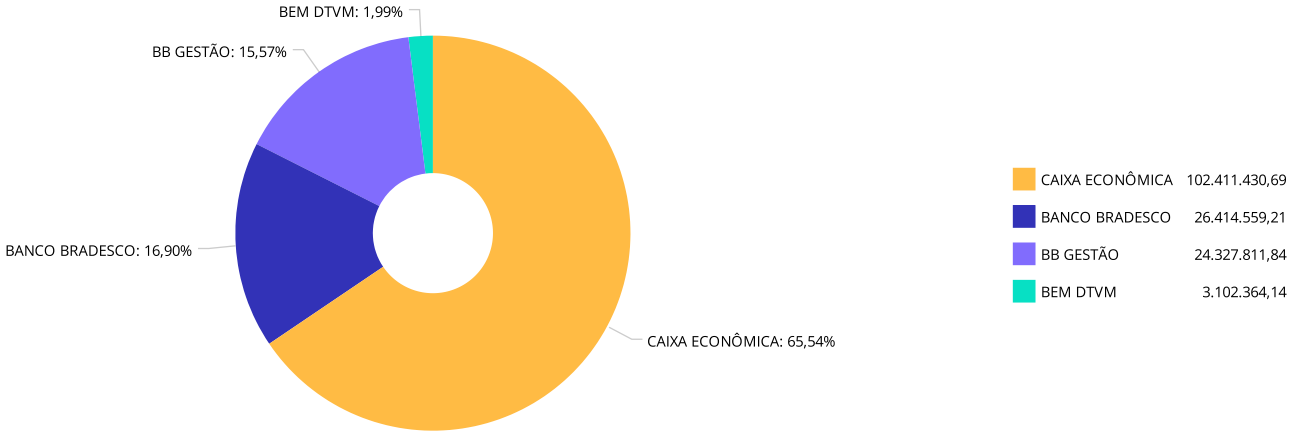
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,47%	14,53%	5,60%	14,53%	13,40%	-1,43%	6,60%	16,781%

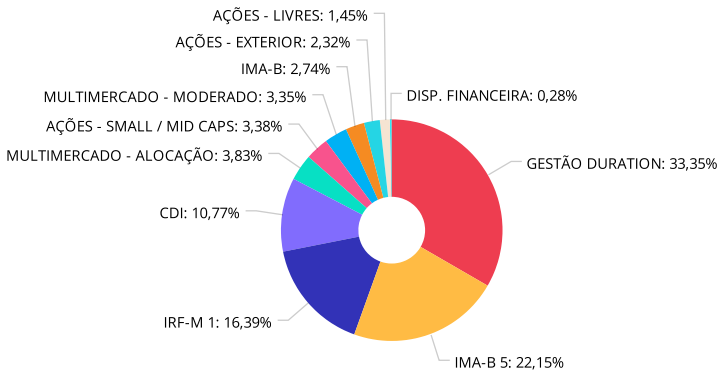
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

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

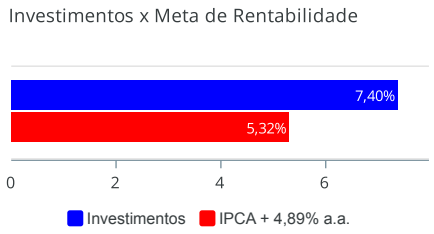


GESTÃO DURATION	52.254.386,34	IMA-B 5	34.701.483,74	IRF-M 1	25.684.190,57	CDI	16.881.591,52
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	6.000.624,43	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	5.294.645,30	MULTIMERCADO - MODERADO	5.246.107,11	IMA-B	4.291.125,05
AÇÕES - EXTERIOR	3.629.541,18	AÇÕES - LIVRES	2.272.470,64	DISP. FINANCEIRA	435.712,51		

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	141.493.171,03	827.480,39	0,00	144.186.699,00	1.866.047,58	1.866.047,58	1,31%	1,31%	0,95%	0,95%	138,03%	1,57%
Fevereiro	144.186.699,00	2.104.228,55	560.000,00	146.309.084,03	578.156,48	2.444.204,06	0,40%	1,71%	1,18%	2,15%	79,84%	1,28%
Março	146.309.084,03	1.066.811,04	180.000,00	148.818.266,14	1.622.371,07	4.066.575,13	1,10%	2,83%	1,15%	3,32%	85,36%	1,13%
Abril	148.818.266,14	7.742.611,43	7.120.000,00	150.712.440,62	1.271.563,05	5.338.138,18	0,85%	3,71%	0,95%	4,31%	86,15%	1,11%
Maio	150.712.440,62	4.770.076,73	4.580.739,29	153.567.515,57	2.665.737,51	8.003.875,69	1,77%	5,54%	0,65%	4,98%	111,23%	1,14%
Junho	153.567.515,57	2.950.443,51	2.965.000,00	156.256.165,88	2.703.206,80	10.707.082,49	1,76%	7,40%	0,32%	5,32%	139,18%	1,26%



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

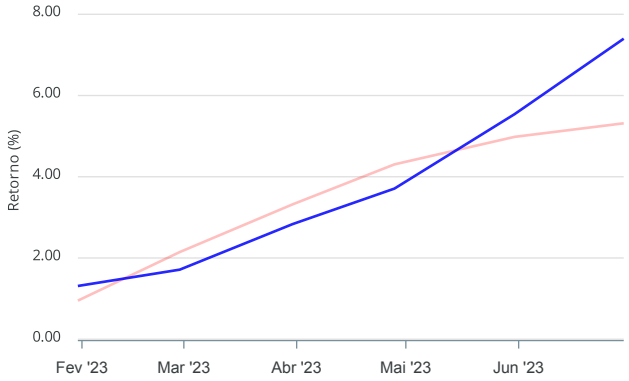
CRÉDITO & MERCADO

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 Junho/2023 **FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	1.500.549,84	0,00	0,00	1.540.520,28	39.970,44	2,66%	2,66%	2,50%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	966.879,77	0,00	0,00	989.951,84	23.072,07	2,39%	2,39%	2,17%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.073.513,73	0,00	0,00	1.099.050,05	25.536,32	2,38%	2,38%	2,19%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	646.390,40	0,00	0,00	661.602,88	15.212,48	2,35%	2,35%	2,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	24.819.856,40	2.380.097,86	0,00	27.745.414,88	545.460,62	2,01%	2,10%	0,90%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	23.546.820,09	565.227,37	0,00	24.508.971,46	396.924,00	1,65%	1,69%	0,56%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.735.440,80	0,00	0,00	14.908.121,04	172.680,24	1,17%	1,17%	0,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	10.387.030,88	0,00	0,00	10.507.372,90	120.342,02	1,16%	1,16%	0,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	260.524,33	5.118,28	0,00	268.696,63	3.054,02	1,15%	1,16%	0,11%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.359.115,72	0,00	0,00	3.397.156,17	38.040,45	1,13%	1,13%	0,02%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.352.313,71	0,00	0,00	2.378.646,74	26.333,03	1,12%	1,12%	0,01%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	9.937.239,89	0,00	2.965.000,00	7.075.324,18	103.084,29	1,04%	1,05%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.577.497,47	0,00	0,00	22.810.396,14	232.898,67	1,03%	1,03%	0,88%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	5.413.895,68	0,00	0,00	5.469.711,67	55.815,99	1,03%	1,03%	0,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.355.852,56	0,00	0,00	6.421.375,93	65.523,37	1,03%	1,03%	0,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	3.992.912,20	0,00	0,00	4.030.464,43	37.552,23	0,94%	0,94%	0,47%
Total Renda Fixa	**131.925.833,47**	**2.950.443,51**	**2.965.000,00**	**133.812.777,22**	**1.901.500,24**	**1,44%**		**0,63%**

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 Junho/2023 **FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.087.010,26	0,00	0,00	2.272.470,64	185.460,38	8,89%	8,89%	7,53%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.029.292,89	0,00	0,00	2.192.281,16	162.988,27	8,03%	8,03%	10,00%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.913.568,28	0,00	0,00	3.102.364,14	188.795,86	6,48%	6,48%	9,10%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	5.846.458,86	0,00	0,00	6.000.624,43	154.165,57	2,64%	2,64%	2,12%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	5.152.721,01	0,00	0,00	5.246.107,11	93.386,10	1,81%	1,81%	1,60%
Total Renda Variável	**18.029.051,30**	**0,00**	**0,00**	**18.813.847,48**	**784.796,18**	**4,35%**		**4,70%**

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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Junho / 2023) **FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.612.630,80	0,00	0,00	3.629.541,18	16.910,38	0,47%	0,47%	6,60%
Total Exterior	**3.612.630,80**	**0,00**	**0,00**	**3.629.541,18**	**16.910,38**	**0,47%**		**6,60%**

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 2º Trimestre/2023 **FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.416.911,32	10.886.464,07	705.000,00	27.745.414,88	1.147.039,49	4,20%	4,86%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	29.908.943,22	565.227,37	7.000.000,00	24.508.971,46	1.034.800,87	3,40%	4,31%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.239.158,13	0,00	0,00	22.810.396,14	571.238,01	2,57%	2,57%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.449.715,14	0,00	0,00	14.908.121,04	458.405,90	3,17%	3,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	10.187.426,26	0,00	0,00	10.507.372,90	319.946,64	3,14%	3,14%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	9.741.085,56	0,00	2.965.000,00	7.075.324,18	299.238,62	3,07%	3,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.261.282,75	0,00	0,00	6.421.375,93	160.093,18	2,56%	2,56%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	5.335.115,85	0,00	0,00	5.469.711,67	134.595,82	2,52%	2,52%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	1.429.533,30	0,00	0,00	1.540.520,28	110.986,98	7,76%	7,76%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.291.063,94	0,00	0,00	3.397.156,17	106.092,23	3,22%	3,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.919.381,42	0,00	3.995.739,29	0,00	76.357,87	1,95%	3,22%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.025.350,08	0,00	0,00	1.099.050,05	73.699,97	7,19%	7,19%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.305.019,96	0,00	0,00	2.378.646,74	73.626,78	3,19%	3,19%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	923.447,68	0,00	0,00	989.951,84	66.504,16	7,20%	7,20%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	617.961,08	0,00	0,00	661.602,88	43.641,80	7,06%	7,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	3.995.739,29	0,00	4.030.464,43	34.725,14	0,87%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	245.004,91	15.700,94	0,00	268.696,63	7.990,78	3,07%	3,15%
Total Renda Fixa	**128.296.400,60**	**15.463.131,67**	**14.665.739,29**	**133.812.777,22**	**4.718.984,24**	**3,66%**	

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 2º Trimestre/2023 **FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.759.925,24	0,00	0,00	2.192.281,16	432.355,92	24,57%	24,57%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.678.362,17	0,00	0,00	3.102.364,14	424.001,97	15,83%	15,83%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.940.097,55	0,00	0,00	2.272.470,64	332.373,09	17,13%	17,13%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	5.676.310,99	0,00	0,00	6.000.624,43	324.313,44	5,71%	5,71%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	5.030.202,53	0,00	0,00	5.246.107,11	215.904,58	4,29%	4,29%
Total Renda Variável	**17.084.898,48**	**0,00**	**0,00**	**18.813.847,48**	**1.728.949,00**	**10,12%**	

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 2º Trimestre/2023 **FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.436.967,06	0,00	0,00	3.629.541,18	192.574,12	5,60%	5,60%
Total Exterior	**3.436.967,06**	**0,00**	**0,00**	**3.629.541,18**	**192.574,12**	**5,60%**	

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 1º Semestre/2023 **FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	27.433.878,63	2.102.796,24	7.000.000,00	24.508.971,46	1.972.296,59	6,68%	7,76%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	15.611.136,02	11.915.505,89	1.445.000,00	27.745.414,88	1.663.772,97	6,04%	8,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.317.391,97	0,00	0,00	22.810.396,14	1.493.004,17	7,00%	7,00%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.989.053,37	0,00	0,00	14.908.121,04	919.067,67	6,57%	6,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	9.866.714,35	0,00	0,00	10.507.372,90	640.658,55	6,49%	6,49%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	8.042.624,02	1.418.330,37	2.965.000,00	7.075.324,18	579.369,79	6,12%	6,38%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.001.871,90	0,00	0,00	6.421.375,93	419.504,03	6,99%	6,99%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	5.114.824,16	0,00	0,00	5.469.711,67	354.887,51	6,94%	6,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.781.640,11	0,00	3.995.739,29	0,00	214.099,18	5,66%	6,98%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.188.836,81	0,00	0,00	3.397.156,17	208.319,36	6,53%	6,53%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	1.377.980,08	0,00	0,00	1.540.520,28	162.540,20	11,80%	11,80%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.245.141,10	0,00	0,00	2.378.646,74	133.505,64	5,95%	5,95%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	985.984,77	0,00	0,00	1.099.050,05	113.065,28	11,47%	11,47%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	889.328,94	0,00	0,00	989.951,84	100.622,90	11,31%	11,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	594.731,66	0,00	0,00	661.602,88	66.871,22	11,24%	11,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	3.995.739,29	0,00	4.030.464,43	34.725,14	0,87%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	223.729,94	29.279,86	0,00	268.696,63	15.686,83	6,20%	6,59%
Total Renda Fixa	**120.664.867,83**	**19.461.651,65**	**15.405.739,29**	**133.812.777,22**	**9.091.997,03**	**7,29%**	

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 após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2023 **FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	5.660.353,95	0,00	0,00	6.000.624,43	340.270,48	6,01%	6,01%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	4.979.616,56	0,00	0,00	5.246.107,11	266.490,55	5,35%	5,35%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.939.327,45	0,00	0,00	2.192.281,16	252.953,71	13,04%	13,04%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.103.047,33	0,00	0,00	2.272.470,64	169.423,31	8,06%	8,06%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.976.882,65	0,00	0,00	3.102.364,14	125.481,49	4,22%	4,22%
Total Renda Variável	**17.659.227,94**	**0,00**	**0,00**	**18.813.847,48**	**1.154.619,54**	**6,54%**	

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 1º Semestre/2023 **FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.169.075,26	0,00	0,00	3.629.541,18	460.465,92	14,53%	14,53%
Total Exterior	**3.169.075,26**	**0,00**	**0,00**	**3.629.541,18**	**460.465,92**	**14,53%**	

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