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
TÍTULOS PÚBLICOS			31.259.135,04	29,05%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	7.508.729,88	6,98%	784	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.007.779,62	0,94%	536	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.004.814,47	0,93%	1.127	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA P...	D+0	Não há	2.999.063,52	2,79%	233	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	6.423.318,06	5,97%	185	0,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	4.173.420,92	3,88%	370	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	180.435,75	0,17%	347	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	8.846.047,73	8,22%	775	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	7.464.590,97	6,94%	921	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.008.720,38	0,94%	313	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.157.105,08	1,08%	971	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.509.804,68	1,40%	156	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	9.916.488,65	9,21%	1.003	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.583.711,31	3,33%	1.518	0,44%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	334.437,88	0,31%	2.785	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.099.215,60	1,02%	21.999	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	8.240.302,18	7,66%	123	1,30%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	586.918,48	0,55%	6.071	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.653.747,25	3,39%	494	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

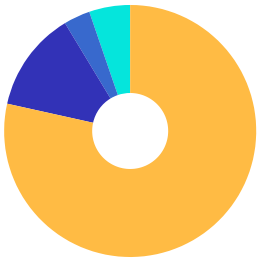
Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	D+4	Não há	2.470.571,35	2,30%	562	1,56%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.190.207,19	2,04%	5.819	0,14%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.003.405,78	0,93%	119	0,16%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		65,85	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			**107.621.971,77**				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			**65,85**				Artigo 6º
PL Total			**107.622.037,62**				

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 Pró Gestão - Nivel 2	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	31.259.135,04	29,05%	15,00%	25,00%	60,00%	33.314.048,02
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	40.616.921,30	37,74%	15,00%	40,00%	60,00%	23.956.261,76
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	12.583.398,41	11,69%	0,00%	10,00%	70,00%	62.751.981,83
Total Renda Fixa	100,00%	84.459.454,75	78,48%	30,00%	75,00%	190,00%	



RENDA FIXA 84.459.454,75

RENDA VARIÁVEL 13.844.585,45

EXTERIOR 3.653.747,25

ESTRUTURADOS 5.664.184,32

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

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

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	13.844.585,45	12,86%	5,00%	15,00%	20,00%	7.679.808,90
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.664.184,32	5,26%	0,00%	5,00%	10,00%	5.098.012,86
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	19.508.769,77	18,13%	5,00%	20,00%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.381.098,59
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.653.747,25	3,39%	0,00%	5,00%	10,00%	7.108.449,93
Total Exterior	10,00%	3.653.747,25	3,39%	0,00%	5,00%	15,00%	

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

Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	43.090.864,36	40,04	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	31.259.135,04	29,05	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	30.801.401,02	28,62	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.470.571,35	2,30	0,00

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 '	31.259.135,04	29,05	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	40.616.921,30	37,74	15,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	12.583.398,41	11,69	5,00	40,00
Artigo 8º, Inciso I	13.844.585,45	12,86	5,00	20,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	3.653.747,25	3,39	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.664.184,32	5,26	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

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%	-	-
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%
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%
IMA-B (Benchmark)	2,53%	8,76%	7,39%	8,55%	10,47%	15,54%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,58%	8,70%	7,35%	8,46%	10,27%	14,95%	1,51%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	2,20%	7,34%	5,54%	8,93%	14,73%	16,57%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,20%	7,30%	5,49%	8,85%	14,60%	16,28%	0,81%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,12%	5,37%	3,25%	6,55%	13,48%	22,43%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,18%	5,25%	3,28%	6,46%	13,49%	22,99%	0,03%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,04%	4,93%	2,98%	6,02%	12,37%	19,93%	0,01%	0,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,18%	4,77%	3,20%	5,96%	13,02%	22,47%	0,03%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,97%	4,60%	2,80%	5,61%	11,56%	18,74%	0,01%	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
IPCA (Benchmark)	0,23%	2,95%	1,56%	3,59%	3,94%	16,13%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,81%	6,03%	3,94%	7,24%	12,48%	16,41%	0,56%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	4,58%	1,78%	5,96%	7,63%	-	0,51%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,54%	8,18%	5,11%	8,52%	-	-	1,16%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-	-	-	-	-	-

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%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,82%	4,76%	3,66%	5,91%	10,85%	14,15%	1,13%	0,04%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,78%	3,48%	3,27%	4,17%	11,61%	16,56%	1,52%	0,04%
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%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,70%	-0,90%	3,15%	-4,34%	-5,27%	-17,03%	8,41%	0,19%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3,08%	-3,48%	0,99%	-5,96%	-9,91%	-15,82%	8,14%	0,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2,71%	-3,81%	0,46%	-6,19%	-10,27%	-16,05%	8,04%	0,18%
IDIV (Benchmark)	0,84%	0,48%	2,64%	-1,14%	-0,85%	1,55%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	6,52%	8,64%	9,15%	7,44%	3,29%	-6,81%	5,73%	0,20%
S&P 500 (Benchmark)	0,25%	8,86%	5,28%	2,44%	1,15%	-0,58%	-	-
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	-1,80%	8,69%	4,07%	3,34%	6,56%	10,78%	6,82%	0,22%
SMLL (Benchmark)	13,54%	4,71%	13,69%	1,56%	-7,34%	-32,24%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	13,18%	4,64%	13,20%	1,51%	-7,90%	-33,41%	10,55%	0,31%

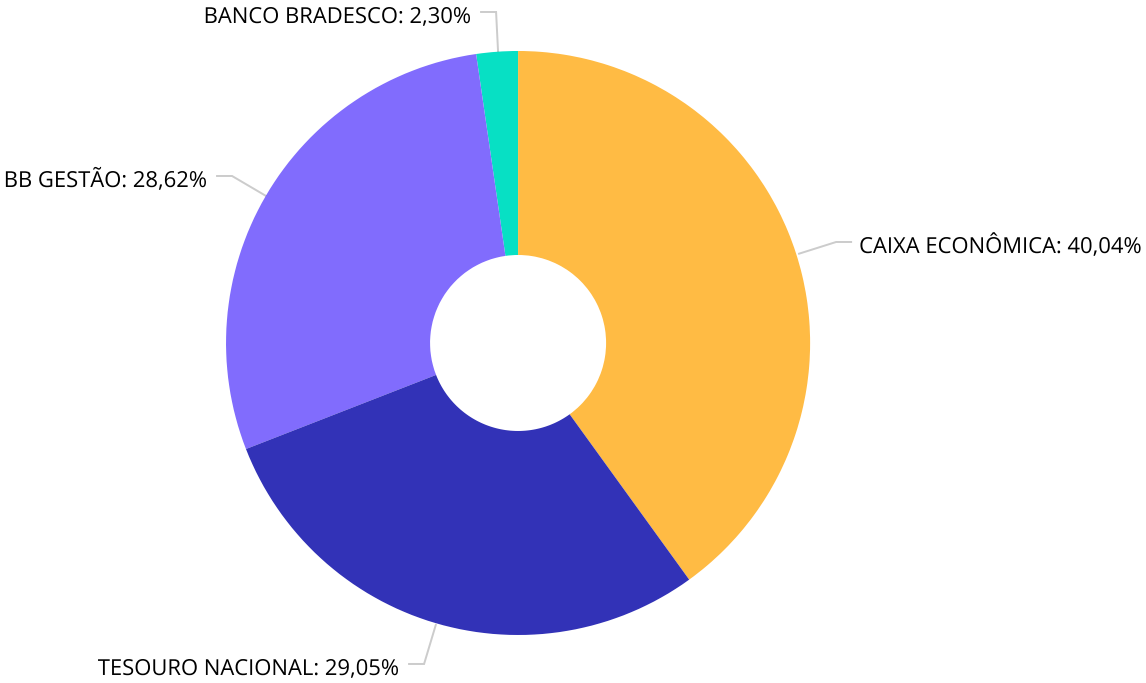
Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

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
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

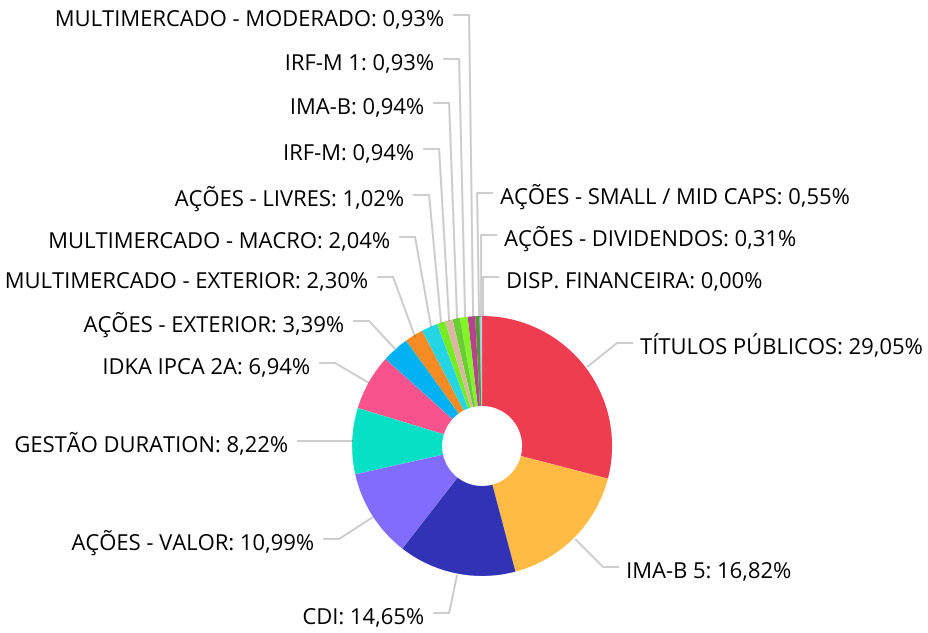
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Maio / 2023)



CAIXA ECONÔMICA	43.090.864,36
TESOURO NACIONAL	31.259.135,04
BB GESTÃO	30.801.401,02
BANCO BRADESCO	2.470.571,35

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

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Maio / 2023)



TÍTULOS PÚBLICOS	31.259.135,04	IMA-B 5	18.105.468,86	CDI	15.762.897,68	AÇÕES - VALOR	11.824.013,49
GESTÃO DURATION	8.846.047,73	IDKA IPCA 2A	7.464.590,97	AÇÕES - EXTERIOR	3.653.747,25	MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.470.571,35
MULTIMERCADO - MACRO	2.190.207,19	AÇÕES - LIVRES	1.099.215,60	IRF-M	1.008.720,38	IMA-B	1.007.779,62
IRF-M 1	1.004.814,47	MULTIMERCADO - MODERADO	1.003.405,78	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	586.918,48	AÇÕES - DIVIDENDOS	334.437,88
DISP. FINANCEIRA	65,85						

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

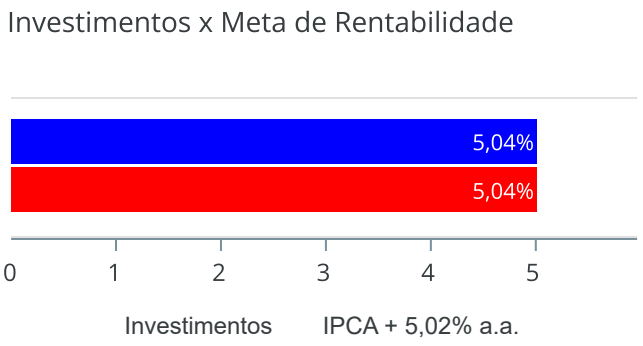
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	$ Pago	$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	19/05/2023	2.184	4.120.532,325000	4.134,308668	8.999.242.597,80	9.029.330,13	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	19/05/2022	1.122	4007,792103	4.171,869807	4.496.742,74	4.680.837,92	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2025	19/05/2023	243	4.112.209,458000	4.124,487144	999.266.898,29	1.002.250,37	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	12/07/2022	981	4076,842282	4.185,392973	3.999.382,28	4.105.870,50	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	13/04/2022	483	4.134,383200	4.268,170264	1.996.907,09	2.061.526,23	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	03/05/2022	480	4158,267333	4.255,121667	1.995.968,32	2.042.458,40	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	13/04/2022	488	4.093,090228	4.349,074037	1.997.428,03	2.122.348,13	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	03/05/2022	486	4109,919684	4.328,882139	1.997.420,97	2.103.836,71	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	13/04/2022	485	4.117,148824	4.255,418789	1.996.817,18	2.063.878,11	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	03/05/2022	483	4137,039810	4.237,678145	1.998.190,23	2.046.798,54	Curva

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

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	99.846.579,24	3.383.637,63	3.567.379,79	101.384.244,35	1.721.407,27	1.721.407,27	1,72%	1,72%	0,96%	0,96%	179,44%	3,14%
Fevereiro	101.384.244,35	2.652.790,84	1.880.361,68	101.949.052,13	-207.621,38	1.513.785,89	-0,20%	1,52%	1,19%	2,17%	70,06%	2,77%
Março	101.949.052,13	2.591.203,09	1.937.378,96	103.496.125,66	893.249,40	2.407.035,29	0,87%	2,40%	1,16%	3,35%	71,63%	2,52%
Abril	103.496.125,66	2.443.014,74	1.703.756,89	105.358.905,66	1.123.522,15	3.530.557,44	1,08%	3,50%	0,96%	4,35%	80,63%	2,45%
Maio	105.358.905,66	19.371.240,71	18.683.154,87	107.621.971,76	1.574.980,26	5.105.537,70	1,49%	5,04%	0,66%	5,04%	100,14%	2,65%

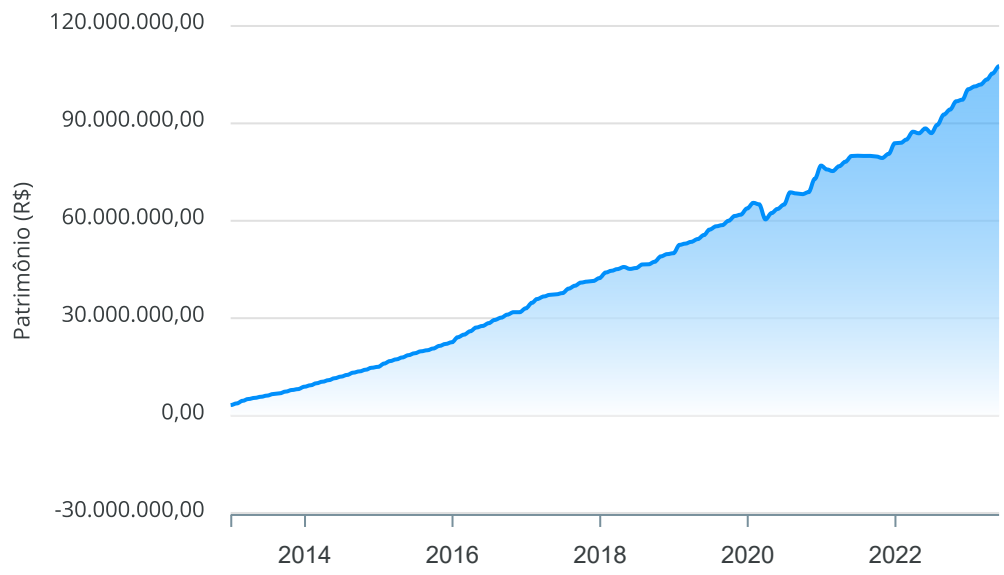


Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

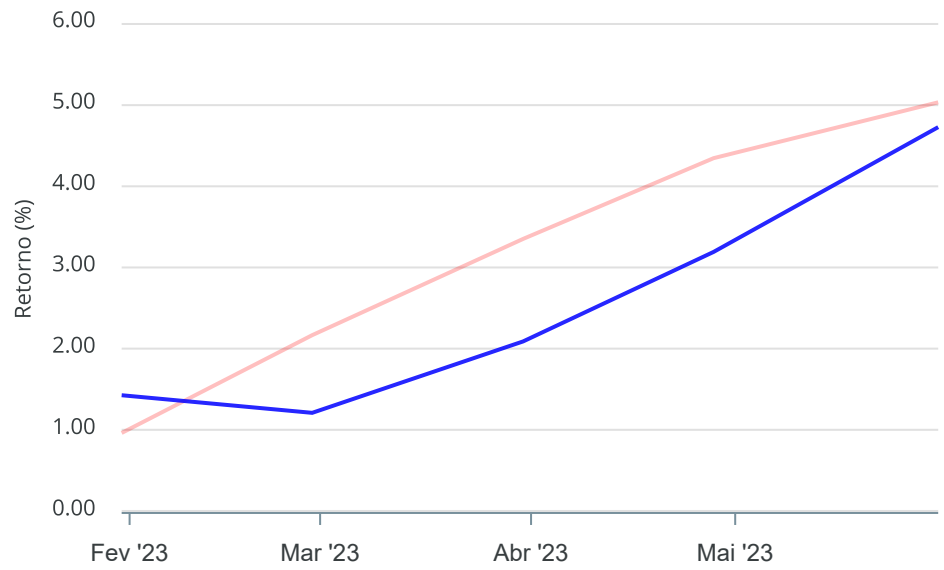
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Maio/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.689.202,94	0,00	0,00	8.846.047,73	156.844,79	1,81%	1,81%	0,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	6.502.739,56	0,00	179.738,55	6.423.318,06	100.317,05	1,54%	1,54%	1,16%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.304.522,12	500.000,00	0,00	9.916.488,65	111.966,53	1,14%	1,18%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.132.379,59	131.973,10	119.354,19	1.157.105,08	12.106,58	0,96%	1,04%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.008.720,38	8.720,38	0,87%	2,20%	0,81%
TÍTULOS PÚBLICOS	25.617.204,05	9.998.509,48	4.641.779,74	31.259.135,04	285.201,25	0,80%	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	4.937.270,15	0,00	3.466.630,62	1.509.804,68	39.165,15	0,79%	1,18%	0,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.007.779,62	7.779,62	0,78%	2,58%	1,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	8.160.817,92	0,00	8.221.025,31	0,00	60.207,39	0,74%	1,19%	0,13%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	7.463.134,92	0,00	0,00	7.508.729,88	45.594,96	0,61%	0,61%	0,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.004.814,47	4.814,47	0,48%	1,12%	0,09%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.437.783,26	0,00	0,00	7.464.590,97	26.807,71	0,36%	0,36%	0,75%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	187.179,21	2.040.758,13	2.054.626,46	180.435,75	7.124,87	0,32%	0,97%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	4.173.796,15	0,00	0,00	4.173.420,92	-375,23	-0,01%	-0,01%	0,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	3.000.000,00	0,00	2.999.063,52	-936,48	-0,03%	-	-
Total Renda Fixa	**83.606.029,87**	**18.671.240,71**	**18.683.154,87**	**84.459.454,75**	**865.339,04**	**1,04%**		**0,56%**

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
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	518.555,02	0,00	0,00	586.918,48	68.363,46	13,18%	13,18%	10,55%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	313.979,50	0,00	0,00	334.437,88	20.458,38	6,52%	6,52%	5,73%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	7.946.256,50	0,00	0,00	8.240.302,18	294.045,68	3,70%	3,70%	8,41%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.066.390,30	0,00	0,00	1.099.215,60	32.825,30	3,08%	3,08%	8,14%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.489.216,23	0,00	0,00	3.583.711,31	94.495,08	2,71%	2,71%	8,04%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.151.127,61	0,00	0,00	2.190.207,19	39.079,58	1,82%	1,82%	1,13%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	985.875,72	0,00	0,00	1.003.405,78	17.530,06	1,78%	1,78%	1,52%
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	2.120.482,44	400.000,00	0,00	2.470.571,35	-49.911,09	-1,98%	-1,80%	6,82%
Total Renda Variável	**18.591.883,32**	**400.000,00**	**0,00**	**19.508.769,77**	**516.886,45**	**2,72%**		**6,97%**

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	3.160.992,48	300.000,00	0,00	3.653.747,25	192.754,77	5,57%	5,80%	8,28%
Total Exterior	**3.160.992,48**	**300.000,00**	**0,00**	**3.653.747,25**	**192.754,77**	**5,57%**		**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

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