

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

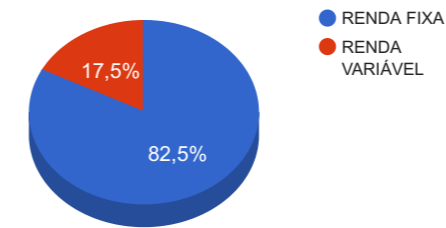
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2019

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (abril / 2019)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	128.145.558,80	10,37%	7,00%	11,00%	15,00%	57.296.317,66
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	452.474.936,35	36,60%	25,00%	33,00%	60,00%	289.292.569,51
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	247.255.835,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	30,00%	370.883.752,93
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	439.827.474,01	35,58%	5,00%	21,00%	40,00%	54.684.196,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	61.220,19	0,00%	1,00%	3,00%	5,00%	61.752.738,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	5,00%	61.813.958,82
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	8,00%	10,00%	123.627.917,64
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	131.163.019,93	10,61%	0,00%	1,00%	10,00%	-7.535.102,29
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	60.149.082,57	4,87%	2,00%	5,00%	10,00%	63.478.835,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.854.915,63	0,72%	1,00%	3,00%	5,00%	52.959.043,19
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	15.602.968,95	1,26%	1,00%	3,00%	5,00%	46.210.989,87
Total Carteira		1.236.279.176,43					

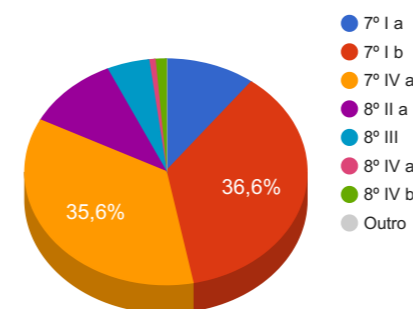
RENDA FIXA 1.020.509.189,35 82,55%
RENDA VARIÁVEL 215.769.987,08 17,45%

Distribuição por Segmento



de Alocação para os Próximos 5 Anos

Distribuição por Artigo / Resolução



Página 1 de 3

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2019

Artigos	Base: abril / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	128.145.558,80	10,37%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	452.474.936,35	36,60%	25,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	439.827.474,01	35,58%	5,00%	40,00%
Total	1.236.279.176,43	100,00%	50,00	220,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (abril / 2019)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP -
Telefone: (13) 3878-8400

Página 2 de 3

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP -
Telefone: (13) 3878-8400

Artigos	Base: abril / 2019 Carteira (\$)	Carteira (%)	Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	61.220,19	0,00%	1,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	1,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	131.163.019,93	10,61%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	60.149.082,57	4,87%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.854.915,63	0,72%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	15.602.968,95	1,26%	1,00%	5,00%
Total	1.236.279.176,43	100,00%	50,00	220,00

respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2019

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	329.349.140,55	26,64%	0,07%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	236.296.666,85	19,11%	0,02%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	128.145.558,80	10,37%	-
ITAÚ UNIBANCO	120.245.155,32	9,73%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	96.830.836,34	7,83%	0,01%
WESTERN ASSET	79.386.908,09	6,42%	0,18%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	62.508.560,77	5,06%	0,20%
Navi Capital	41.924.206,31	3,39%	2,29%
XP GESTÃO DE RECURSOS	31.348.424,76	2,54%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	23.026.970,12	1,86%	4,04%
ITAÚ DTVM	20.126.967,45	1,63%	0,00%
Vinci Gestão de Patrimônio Ltda	19.795.581,31	1,60%	0,09%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	15.167.467,26	1,23%	0,04%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	8.324.698,49	0,67%	1,89%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	6.807.887,48	0,55%	0,01%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
A5 CAPITAL PARTNERS	5.354.415,22	0,43%	-%
MÉRITO INVESTIMENTOS	5.288.360,00	0,43%	-%
REAG GESTORA DE RECURSOS	1.989.910,46	0,16%	0,02%%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.787.485,64	0,14%	0,00%%
ROMA ASSET	1.231.462,82	0,10%	0,36%%
CAPITÂNIA	799.740,25	0,06%	0,01%%
BRASIL PLURAL	481.551,95	0,04%	0,00%%
Gradual Investimentos	61.220,19	0,00%	0,04%%

Página 3 de 3

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP -
Telefone: (13) 3878-8400