

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/08/2019

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	107.312.348,60	8,15%	7,00%	11,00%	15,00%	90.147.259,37
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	490.485.322,46	37,26%	25,00%	33,00%	60,00%	299.353.109,43
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	263.279.477,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	30,00%	394.919.215,95
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	474.398.745,33	36,04%	5,00%	21,00%	40,00%	52.160.209,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	60.862,42	0,00%	1,00%	3,00%	5,00%	65.759.006,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	5,00%	65.819.869,32
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	8,00%	10,00%	131.639.738,65
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	164.638.284,81	12,51%	0,00%	1,00%	10,00%	-32.998.546,16
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	60.541.234,28	4,60%	2,00%	5,00%	10,00%	71.098.504,37
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.779.524,10	0,67%	1,00%	3,00%	5,00%	57.040.345,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	10.181.064,49	0,77%	1,00%	3,00%	5,00%	55.638.804,83
Total Carteira		1.316.397.386,49					

RENDA FIXA 1.072.257.278,81 18,45%
 RENDA VARIÁVEL 244.140.107,68 18,55%

Distribuição por Segmento RENDA
 FIXA RENDA VARIÁVEL 18,5% 81,5%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Distribuição por Artigo / Resolução 7º I a 7º I b 7º IV a 8º II a 8º III 8º IV a 8º IV b 37,3% 36%

Página 1 de 3

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/08/2019

Artigos	Base: agosto / 2019		Limite	
	Carteira (\$)	Carteira (%)	Inferior (%)	Superior (%)
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	107.312.348,60	8,15%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	490.485.322,46	37,26%	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 "	474.398.745,33	36,04%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	60.862,42	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 "	164.638.284,81	12,51%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	60.541.234,28	4,60%	2,00%	10,00%
Total	1.316.397.386,49	100,00%	50,00	220,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (agosto / 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: agosto / 2019		Limite	Limite
	Carteira (\$)	Carteira (%)	Inferior (%)	Superior (%)
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.779.524,10	0,67%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	10.181.064,49	0,77%	1,00%	5,00%
Total	1.316.397.386,49	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 - 30/08/2019

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	370.984.748,61	28,18%	0,07%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	277.360.442,90	21,07%	0,03%
ITAÚ UNIBANCO	142.334.923,52	10,81%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	107.312.348,60	8,15%	-
WESTERN ASSET	91.374.945,47	6,94%	0,21%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	90.455.653,56	6,87%	0,01%
Navi Capital	46.684.032,66	3,55%	2,77%
XP GESTÃO DE RECURSOS	33.442.087,90	2,54%	0,00%
Vinci Gestão de Patrimônio Ltda	31.244.327,90	2,37%	0,13%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	29.346.783,33	2,23%	4,13%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	24.473.818,45	1,86%	0,07%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	22.944.285,13	1,74%	0,07%
ITAÚ DTVM	21.801.590,45	1,66%	0,00%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	8.220.642,88	0,62%	1,86%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	6.927.273,13	0,53%	0,01%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
A5 CAPITAL PARTNERS	5.318.339,25	0,40%	-%
REAG GESTORA DE RECURSOS	1.960.421,61	0,15%	0,02%%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.783.363,01	0,14%	0,00%%
ROMA ASSET	1.228.995,48	0,09%	1,01%%
CAPITÂNIA	688.673,87	0,05%	0,01%%
BRASIL PLURAL	448.826,36	0,03%	0,00%%
Gradual Investimentos	60.862,42	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