

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2019

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	125.687.925,10	10,41%	7,00%	11,00%	15,00%	55.404.075,10
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	442.832.704,68	36,68%	25,00%	33,00%	60,00%	281.535.296,13
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	241.456.000,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	30,00%	362.184.000,41
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	446.393.659,33	36,98%	5,00%	21,00%	40,00%	36.518.341,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	64.657,08	0,01%	1,00%	3,00%	5,00%	60.299.342,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	5,00%	60.364.000,07
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	20.420.310,58	1,69%	2,00%	8,00%	10,00%	100.307.689,56
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	92.663.456,08	7,68%	0,00%	1,00%	10,00%	28.064.544,06
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	56.906.572,03	4,71%	2,00%	5,00%	10,00%	63.821.428,11
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.155.671,71	0,68%	1,00%	3,00%	5,00%	52.208.328,36
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	14.155.044,76	1,17%	1,00%	3,00%	5,00%	46.208.955,31
Total Carteira		1.207.280.001,35					

RENDA FIXA 1.014.978.946,1984,07%
 RENDA VARIÁVEL 192.301.055,1615,93%

Distribuição por Segmento RENDA
 FIXA RENDA VARIÁVEL 84,1%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Página 1 de 3

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2019

Artigos	Base: janeiro / 2019		Limite	
	Carteira (\$)	Carteira (%)	Inferior (%)	Superior (%)
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	125.687.925,10	10,41%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	442.832.704,68	36,68%	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 "	446.393.659,33	36,98%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	64.657,08	0,01%	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 "	20.420.310,58	1,69%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	92.663.456,08	7,68%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	56.906.572,03	4,71%	2,00%	10,00%
Total	1.207.280.001,35	100,00%	50,00	220,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 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: janeiro / 2019		Limite	Limite
	Carteira (\$)	Carteira (%)	Inferior (%)	Superior (%)
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.155.671,71	0,68%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	14.155.044,76	1,17%	1,00%	5,00%
Total	1.207.280.001,35	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 - 31/01/2019

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	338.174.097,35	28,01%	0,07%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	230.663.835,13	19,11%	0,02%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	125.687.925,10	10,41%	-
ITAÚ UNIBANCO	113.504.363,48	9,40%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	99.906.437,23	8,28%	0,01%
WESTERN ASSET	75.597.647,17	6,26%	0,17%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	60.793.889,16	5,04%	0,19%
Navi Capital	42.704.416,75	3,54%	2,31%
XP GESTÃO DE RECURSOS	30.874.860,17	2,56%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	23.467.572,36	1,94%	5,30%
ITAÚ DTVM	20.420.310,58	1,69%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	15.490.781,61	1,28%	0,05%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	8.287.444,76	0,69%	1,88%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	6.813.794,53	0,56%	0,01%
A5 CAPITAL PARTNERS	5.379.726,73	0,45%	-

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
MÉRITO INVESTIMENTOS	4.807.600,00	0,40%	-%
ROMA ASSET	1.233.100,68	0,10%	0,28%%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.060.113,09	0,09%	0,00%%
REAG GESTORA DE RECURSOS	1.060.000,00	0,09%	0,02%%
CAPITÂNIA	804.697,18	0,07%	0,01%%
BRASIL PLURAL	482.731,21	0,04%	0,00%%
Gradual Investimentos	64.657,08	0,01%	-%

Página 3 de 3

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