

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/07/2019

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	108.154.075,77	8,23%	7,00%	11,00%	15,00%	89.021.870,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	488.251.000,85	37,14%	25,00%	33,00%	60,00%	300.452.783,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	262.901.261,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	30,00%	394.351.892,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	492.203.396,62	37,44%	5,00%	21,00%	40,00%	33.599.126,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	62.225,40	0,00%	1,00%	3,00%	5,00%	65.663.089,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	5,00%	65.725.315,35
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	8,00%	10,00%	131.450.630,69
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	146.052.781,52	11,11%	0,00%	1,00%	10,00%	-14.602.150,83
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	60.763.157,41	4,62%	2,00%	5,00%	10,00%	70.687.473,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.814.039,68	0,67%	1,00%	3,00%	5,00%	56.911.275,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	10.205.629,68	0,78%	1,00%	3,00%	5,00%	55.519.685,67
Total Carteira		1.314.506.306,93					

RENDA FIXA 1.088.670.698,6482,82%
 RENDA VARIÁVEL 225.835.608,2917,18%

Distribuição por Segmento RENDA
 FIXA RENDA VARIÁVEL 82,8%

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 Outro 37,1% 37,4%

Página 1 de 3

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/07/2019

Artigos	Base: julho / 2019		Limite	
	Carteira (\$)	Carteira (%)	Inferior (%)	Superior (%)
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	108.154.075,77	8,23%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	488.251.000,85	37,14%	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 "	492.203.396,62	37,44%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	62.225,40	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 "	146.052.781,52	11,11%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	60.763.157,41	4,62%	2,00%	10,00%
Total	1.314.506.306,93	100,00%	50,00	220,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (julho / 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: julho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.814.039,68	0,67%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	10.205.629,68	0,78%	1,00%	5,00%
Total	1.314.506.306,93	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 - 31/07/2019

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	377.904.627,80	28,75%	0,08%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	278.603.725,58	21,19%	0,03%
ITAÚ UNIBANCO	127.247.022,67	9,68%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	108.154.075,77	8,23%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	100.790.656,15	7,67%	0,01%
WESTERN ASSET	81.793.308,34	6,22%	0,18%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	46.327.704,99	3,52%	0,13%
Navi Capital	45.534.374,93	3,46%	2,69%
XP GESTÃO DE RECURSOS	32.870.344,00	2,50%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	27.511.785,03	2,09%	4,03%
ITAÚ DTVM	21.751.068,71	1,65%	0,00%
Vinci Gestão de Patrimônio Ltda	21.395.484,38	1,63%	0,09%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	17.731.249,01	1,35%	0,05%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	8.224.191,21	0,63%	1,86%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	7.119.902,10	0,54%	0,01%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
A5 CAPITAL PARTNERS	5.327.542,30	0,41%	-%
REAG GESTORA DE RECURSOS	1.981.438,47	0,15%	0,02%%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.788.496,70	0,14%	0,00%%
ROMA ASSET	1.229.590,62	0,09%	1,01%%
CAPITÂNIA	689.082,71	0,05%	0,01%%
BRASIL PLURAL	468.410,06	0,04%	0,00%%
Gradual Investimentos	62.225,40	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