

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/05/2019

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	104.005.114,80	8,22%	7,00%	11,00%	15,00%	85.877.704,06
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	456.112.166,56	36,03%	25,00%	33,00%	60,00%	303.419.108,88
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	253.177.091,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	30,00%	379.765.637,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	491.756.230,91	38,85%	5,00%	21,00%	40,00%	14.597.952,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	61.220,19	0,00%	1,00%	3,00%	5,00%	63.233.052,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	5,00%	63.294.272,95
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	8,00%	10,00%	126.588.545,91
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	133.239.334,21	10,53%	0,00%	1,00%	10,00%	-6.650.788,30
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	58.144.735,04	4,59%	2,00%	5,00%	10,00%	68.443.810,87
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.839.470,81	0,70%	1,00%	3,00%	5,00%	54.454.802,14
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	13.727.186,54	1,08%	1,00%	3,00%	5,00%	49.567.086,41
Total Carteira		1.265.885.459,06					

RENDA FIXA 1.051.934.732,4683,10%
 RENDA VARIÁVEL 213.950.726,6016,90%

Distribuição por Segmento RENDA
 FIXA RENDA VARIÁVEL 83,1%

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 36% 38,8%

Página 1 de 3

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/05/2019

Artigos	Base: maio / 2019		Limite	
	Carteira (\$)	Carteira (%)	Inferior (%)	Superior (%)
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	104.005.114,80	8,22%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	456.112.166,56	36,03%	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 "	491.756.230,91	38,85%	5,00%	40,00%
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 "	133.239.334,21	10,53%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	58.144.735,04	4,59%	2,00%	10,00%
Total	1.265.885.459,06	100,00%	50,00	220,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (maio / 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: maio / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.839.470,81	0,70%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	13.727.186,54	1,08%	1,00%	5,00%
Total	1.265.885.459,06	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 - 31/05/2019

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	369.286.551,67	29,17%	0,08%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	245.010.112,01	19,35%	0,03%
ITAÚ UNIBANCO	122.646.355,00	9,69%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	104.005.114,80	8,22%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	98.125.139,52	7,75%	0,01%
WESTERN ASSET	78.042.759,88	6,17%	0,17%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	64.821.738,13	5,12%	0,20%
Navi Capital	42.606.140,38	3,37%	2,46%
XP GESTÃO DE RECURSOS	31.908.788,71	2,52%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	23.368.997,72	1,85%	4,02%
ITAÚ DTVM	20.329.969,25	1,61%	0,00%
Vinci Gestão de Patrimônio Ltda	20.066.638,38	1,59%	0,09%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	15.351.175,84	1,21%	0,05%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	8.475.441,63	0,67%	1,92%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	6.913.491,51	0,55%	0,01%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
A5 CAPITAL PARTNERS	5.345.161,42	0,42%	-%
MÉRITO INVESTIMENTOS	3.262.500,00	0,26%	-%
REAG GESTORA DE RECURSOS	1.989.244,91	0,16%	0,02%%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.782.706,75	0,14%	0,00%%
ROMA ASSET	1.230.872,02	0,10%	0,27%%
CAPITÂNIA	774.608,72	0,06%	0,01%%
BRASIL PLURAL	480.730,62	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