

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 29/03/2019

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	126.637.248,31	10,41%	7,00%	11,00%	15,00%	55.836.802,57
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	446.905.646,27	36,74%	25,00%	33,00%	60,00%	282.990.557,26
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	243.298.734,51
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	30,00%	364.948.101,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	430.819.711,63	35,41%	5,00%	21,00%	40,00%	55.777.757,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	61.220,19	0,01%	1,00%	3,00%	5,00%	60.763.463,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	5,00%	60.824.683,63
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	19.934.573,14	1,64%	2,00%	8,00%	10,00%	101.714.794,12
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	109.841.669,20	9,03%	0,00%	1,00%	10,00%	11.807.698,06
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	58.777.390,70	4,83%	2,00%	5,00%	10,00%	62.871.976,56
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.869.039,08	0,73%	1,00%	3,00%	5,00%	51.955.644,55
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	14.647.174,03	1,20%	1,00%	3,00%	5,00%	46.177.509,60
Total Carteira		1.216.493.672,55					

RENDA FIXA 1.004.423.826,4082,57%
RENDA VARIÁVEL 212.069.846,1517,43%

Distribuição por Segmento RENDA
FIXA RENDA VARIÁVEL 17,4% 82,6%

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% 9% 35,4%

Página 1 de 3

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SANTOS

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 29/03/2019

Artigos	Base: março / 2019		Limite	
	Carteira (\$)	Carteira (%)	Inferior (%)	Superior (%)
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	126.637.248,31	10,41%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	446.905.646,27	36,74%	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 "	430.819.711,63	35,41%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	61.220,19	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 "	19.934.573,14	1,64%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	109.841.669,20	9,03%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	58.777.390,70	4,83%	2,00%	10,00%
Total	1.216.493.672,55	100,00%	50,00	220,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (março / 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: março / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.869.039,08	0,73%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	14.647.174,03	1,20%	1,00%	5,00%
Total	1.216.493.672,55	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 - 29/03/2019

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	321.401.784,62	26,42%	0,07%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	232.954.588,17	19,15%	0,02%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	126.637.248,31	10,41%	-
ITAÚ UNIBANCO	119.392.342,39	9,81%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	95.859.495,43	7,88%	0,01%
WESTERN ASSET	77.687.974,74	6,39%	0,17%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	61.557.387,85	5,06%	0,19%
Navi Capital	41.729.496,43	3,43%	2,35%
XP GESTÃO DE RECURSOS	30.786.143,30	2,53%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	22.987.965,71	1,89%	4,25%
ITAÚ DTVM	19.934.573,14	1,64%	0,00%
Vinci Gestão de Patrimônio Ltda	19.660.119,31	1,62%	0,09%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	14.790.837,08	1,22%	0,04%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	8.250.698,03	0,68%	1,87%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	6.735.473,09	0,55%	0,01%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
A5 CAPITAL PARTNERS	5.363.262,61	0,44%	-%
MÉRITO INVESTIMENTOS	5.336.436,00	0,44%	-%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.791.805,24	0,15%	0,00%%
ROMA ASSET	1.232.013,80	0,10%	0,37%%
REAG GESTORA DE RECURSOS	1.060.040,00	0,09%	0,01%%
CAPITÂNIA	800.809,68	0,07%	0,01%%
BRASIL PLURAL	481.957,43	0,04%	0,00%%
Gradual Investimentos	61.220,19	0,01%	0,61%%

Página 3 de 3

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