



Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2017



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

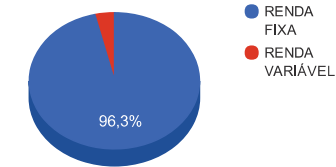


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (janeiro / 2017)

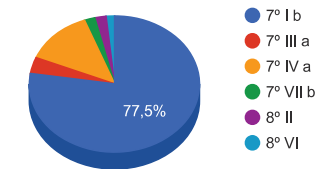
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	60.765.483,24	77,47%	50,00%	60,00%	100,00%	17.675.187,19
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	3.045.031,55	3,88%	0,00%	5,00%	80,00%	59.707.504,79
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	80,00%	62.752.536,34
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	10.151.252,47	12,94%	10,00%	15,00%	30,00%	13.380.948,66
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	23.532.201,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.552.943,06	1,98%	0,00%	2,00%	5,00%	2.369.090,46
Total Renda Fixa	100,00%	75.514.710,32	96,27%	60,00	90,00	355,00	-

Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	1.688.580,00	2,15%	0,00%	5,00%	10,00%	6.155.487,04
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.922.033,52
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.235.988,00	1,58%	0,00%	0,00%	5,00%	2.686.045,52
Total Renda Variável	30,00%	2.924.568,00	3,73%	0,00	10,00	60,00	-

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução

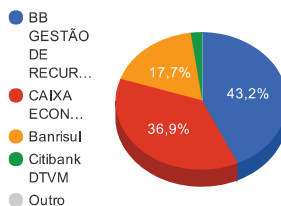




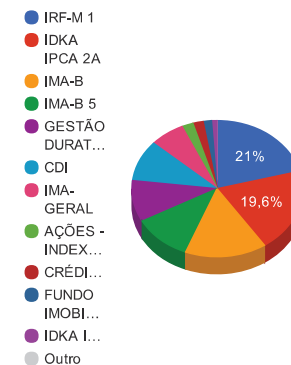
FUNDO MUNICIPAL DE APOSENTADORIA E PENSÃO DO SERVIDOR
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2017

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (janeiro / 2017)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.874.654,86	43,19%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	28.973.979,16	36,94%
Banrisul	13.902.064,30	17,72%
Citibank DTVM	1.688.580,00	2,15%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.392,11	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	16.437.836,53	20,96%
IDKA IPCA 2A	15.401.780,30	19,63%
IMA-B	12.095.565,47	15,42%
IMA-B 5	8.674.325,60	11,06%
GESTÃO DURATION	7.712.566,61	9,83%
CDI	7.605.912,47	9,70%
IMA-GERAL	5.217.989,26	6,65%
AÇÕES - INDEXADO	1.688.580,00	2,15%
CRÉDITO PRIVADO	1.552.943,06	1,98%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.235.988,00	1,58%
IDKA IPCA 20A	815.791,02	1,04%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.392,11	0,00%





FUNDO MUNICIPAL DE APOSENTADORIA E PENSÃO DO SERVIDOR
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2017

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	76.016.321,52	6.840.417,77	5.468.959,71	78.439.278,32	1.051.498,74	1,36%	0,89%	152,67%	1,58%
Acumulado no ano					1.051.498,74	1,36%	0,89%	152,67%	

Acumulado no Ano

