



Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2017



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

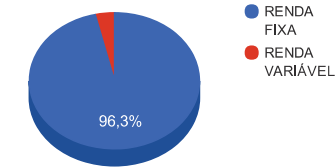


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (fevereiro / 2017)

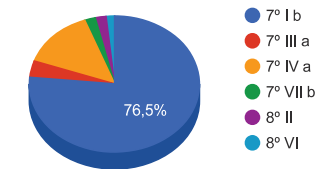
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	61.403.278,85	76,52%	50,00%	60,00%	100,00%	18.837.094,37
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	3.128.345,60	3,90%	0,00%	5,00%	80,00%	61.063.952,98
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	80,00%	64.192.298,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	11.155.615,97	13,90%	10,00%	15,00%	30,00%	12.916.496,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	24.072.111,97
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.587.361,49	1,98%	0,00%	2,00%	5,00%	2.424.657,17
Total Renda Fixa	100,00%	77.274.601,91	96,30%	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%	1.648.830,00	2,05%	0,00%	5,00%	10,00%	6.375.207,32
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.012.018,66
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.296.000,00	1,62%	0,00%	0,00%	5,00%	2.716.018,66
Total Renda Variável	30,00%	2.944.830,00	3,67%	0,00	10,00	60,00	-

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução

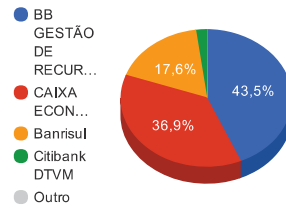




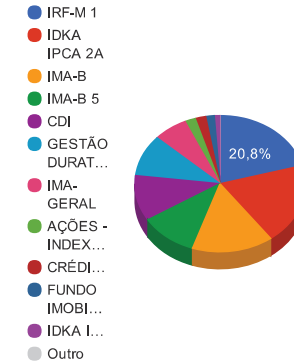
FUNDO MUNICIPAL DE APOSENTADORIA E PENSÃO DO SERVIDOR
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 24/02/2017

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.909.229,51	43,51%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.571.133,73	36,85%
Banrisul	14.090.238,67	17,56%
Citibank DTVM	1.648.830,00	2,05%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	20.941,31	0,03%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	16.675.183,93	20,78%
IDKA IPCA 2A	15.321.009,94	19,09%
IMA-B	12.306.571,97	15,34%
IMA-B 5	8.724.999,83	10,87%
CDI	8.662.415,97	10,80%
GESTÃO DURATION	7.887.729,08	9,83%
IMA-GERAL	5.234.170,09	6,52%
AÇÕES - INDEXADO	1.648.830,00	2,05%
CRÉDITO PRIVADO	1.587.361,49	1,98%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.296.000,00	1,62%
IDKA IPCA 20A	875.159,61	1,09%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	20.941,31	0,03%





FUNDO MUNICIPAL DE APOSENTADORIA E PENSÃO DO SERVIDOR
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 24/02/2017

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%
Fevereiro	78.439.278,32	3.635.696,80	3.194.580,78	80.219.431,91	1.339.037,57	1,70%	0,75%	226,34%	1,66%
Acumulado no ano					2.390.536,31	3,08%	1,65%	187,00%	

Acumulado no Ano

