



Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2017



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

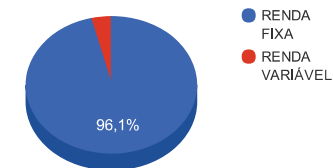


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (março / 2017)

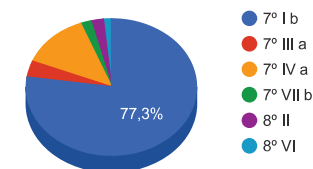
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	62.894.194,80	77,08%	50,00%	60,00%	100,00%	18.703.051,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	3.164.408,04	3,88%	0,00%	5,00%	80,00%	62.113.388,82
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	80,00%	65.277.796,86
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	10.527.381,36	12,90%	10,00%	15,00%	30,00%	13.951.792,46
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	24.479.173,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.615.013,63	1,98%	0,00%	2,00%	5,00%	2.464.848,67
Total Renda Fixa	100,00%	78.200.997,83	95,84%	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%	1.924.855,00	2,36%	0,00%	5,00%	10,00%	6.234.869,61
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.079.862,30
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.260.000,00	1,54%	0,00%	0,00%	5,00%	2.819.862,30
Total Renda Variável	30,00%	3.184.855,00	3,90%	0,00	10,00	60,00	-

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução

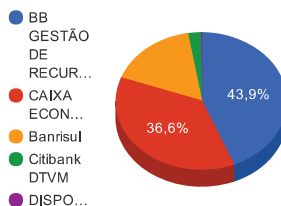




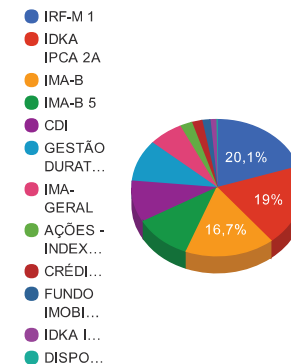
FUNDO MUNICIPAL DE APOSENTADORIA E PENSÃO DO SERVIDOR
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2017

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.794.098,87	43,87%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.880.710,45	36,62%
Banrisul	13.786.188,51	16,90%
Citibank DTVM	1.924.855,00	2,36%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	211.393,24	0,26%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	16.404.386,72	20,10%
IDKA IPCA 2A	15.529.513,28	19,03%
IMA-B	13.646.660,23	16,72%
IMA-B 5	8.844.022,16	10,84%
CDI	8.012.881,36	9,82%
GESTÃO DURATION	7.982.772,87	9,78%
IMA-GERAL	5.287.747,43	6,48%
AÇÕES - INDEXADO	1.924.855,00	2,36%
CRÉDITO PRIVADO	1.615.013,63	1,98%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.260.000,00	1,54%
IDKA IPCA 20A	878.000,15	1,08%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	211.393,24	0,26%





FUNDO MUNICIPAL DE APOSENTADORIA E PENSÃO DO SERVIDOR
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/03/2017

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%
Março	80.219.431,91	2.646.157,08	2.340.547,66	81.385.852,83	860.811,50	1,07%	0,76%	139,84%	1,20%
Acumulado no ano					3.251.347,81	4,18%	2,42%	172,51%	

Acumulado no Ano

