

ATA DE REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO HORTOPREV

No dia 04 de setembro de 2017, às 08h30 horas, reuniram-se em reunião os membros do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência dos Servidores públicos de Hortolândia, a saber os senhores(as) Tatiana Tiemi Toku de Araujo, Thais Santos Feitoza, Andressa de Lima e Alcir Furtado Pesse, na sede do Hortoprev, rua Alda Lourenço Francisco, 160, Remanso Campineiro, Hortolândia/SP, de portas abertas, sendo aberto a qualquer segurado ou pensionista participar como ouvinte desta reunião. O Comitê de Investimentos, por sua vez, também convidou as ocupantes das cadeiras da Diretoria Executiva, a saber, Sr. Antonio Bonadio (Diretor Superintendente – APIMEC CGRPPS), Sr. Agnaldo Messias Rodrigues (Diretor Financeiro – APIMEC CGRPPS), e Sr. Leonardo Dell Antonio Facchini (Economista – CPA-10) para participar da reunião, sendo estes apenas com direito a voz nesta reunião mas não a voto, dos quais participaram todos. Dada as disposições preliminares, e demais apresentações, a seguinte reunião teve sua seguinte pauta e discussões. **Proposta de Investimentos:** Todos os presentes, após ouvirem as posições do Economista, Diretor Superintendente e Diretor Financeiro do Hortoprev, que após seus estudos de credenciamento do BNP PARIBAS Banco e Asset e inclusive suas diligências internas, entenderam que o fundo BNP PARIBAS ACTION FICFIA apresentou retornos superiores aos demais da carteira do Hortoprev em diversos períodos e cumpriram os cinco critérios apresentados pelo consultor Paulo Di Blasi na reunião de 17 de agosto de 2017, portanto, todos propõem o resgate total do fundo GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS para o referido BNP PARIBAS ACTION FICFIA, a ser levado para apreciação do Conselho de Administração o quanto antes devido a necessidade de reajuste da carteira de ações do Instituto. O Comitê considera ainda a possibilidade de reforçar a posição do fundo AZ QUEST SMALL MID CAPS FICFIA que tem apresentado retorno muito bom nos últimos períodos e ainda o estudo para um novo fundo que apresenta também resultado muito bom, a saber, OCEANA SELECTION FICFIA.

Comitê de Investimentos

TATIANA TIEMI TOKU DE ARAUJO 

ANDRESSA DE LIMA 

THAIS SANTOS FEITOZA 

ALCIR FURTADO PESSE 

Demais presentes:

AGNALDO MESSIAS RODRIGUES 

ANTONIO AGNELO BONADIO

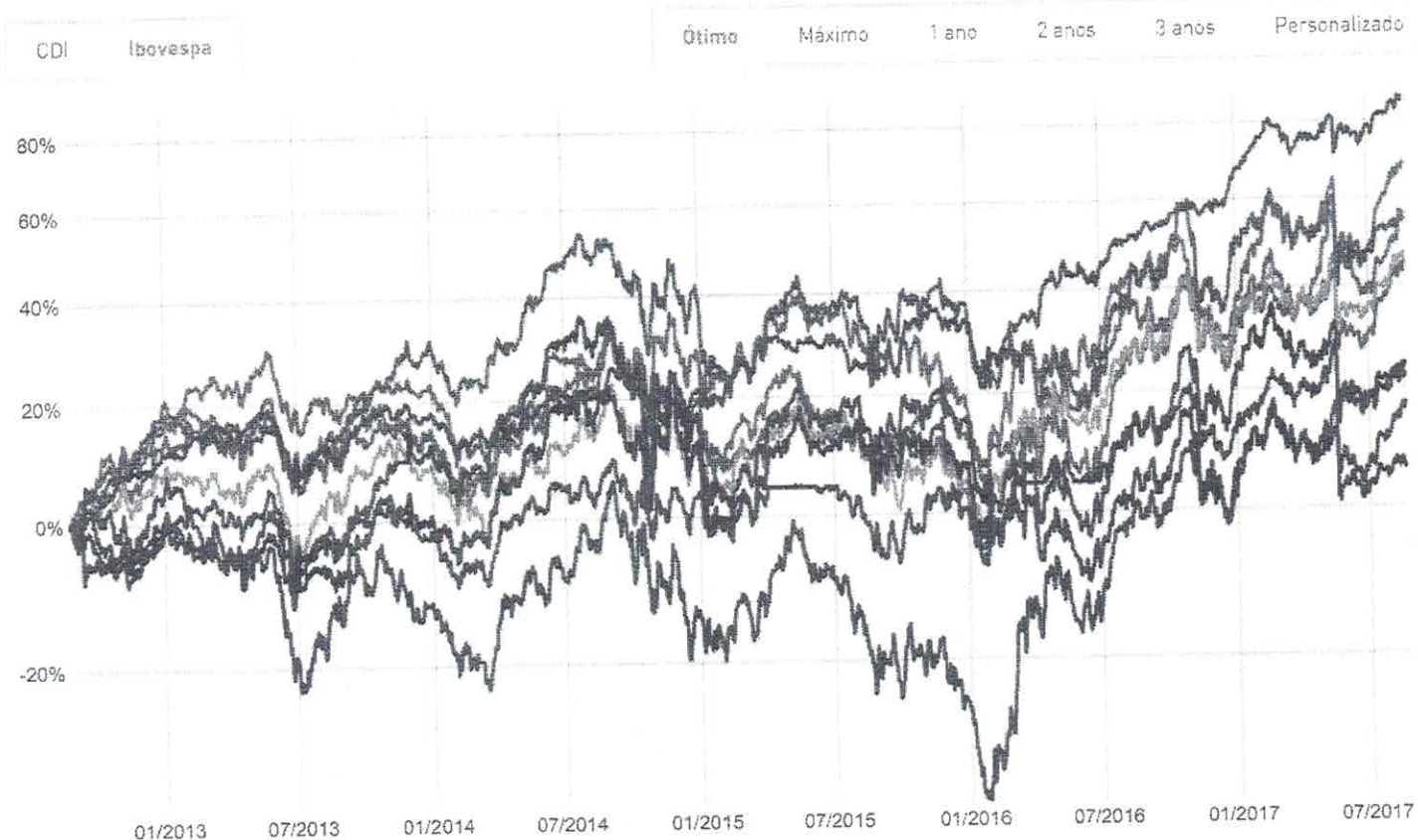
LEONARDO DELL ANTONIO FACCHINI 



Comparação de fundos

Busque por nome ou CNPJ de fundos para incluir na comparação

Rentabilidade Underwater Volatilidade Correlação



IBOVESPA

Rentab. absoluta: 17,30% Rentab. relativa: 0,00 p.p. Consistência: N/A Sharpe (risco/retorno): N/A Risco: 23,13%

AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES

Rentab. absoluta: 68,05% Rentab. relativa: 50,75 p.p. Consistência: 57,47% Sharpe (risco/retorno): 0,50 Risco: 15,26%

AZ QUEST AÇÕES FIC FI DE AÇÕES

Rentab. absoluta: 44,39% Rentab. relativa: 27,09 p.p. Consistência: 54,56% Sharpe (risco/retorno): 0,24 Risco: 17,97%

BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

Rentab. absoluta: 55,52% Rentab. relativa: 38,21 p.p. Consistência: 61,08% Sharpe (risco/retorno): 0,35 Risco: 17,21%

BRZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES

Rentab. absoluta: 46,57% Rentab. relativa: 29,27 p.p. Consistência: 64,29% Sharpe (risco/retorno): 0,28 Risco: 16,60%

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS

Rentab. absoluta: 24,70% Rentab. relativa: 7,40 p.p. Consistência: 58,35% Sharpe (risco/retorno): 0,09 Risco: 14,92%

■ GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES

Rentab. absoluta: 22,03% Rentab. relativa: 4,73 p.p. Consistência: 51,45% Sharpe (risco/retorno): 0,04 Risco: 18,90%

**■ GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES**

Rentab. absoluta: 6,60% Rentab. relativa: -10,70 p.p. Consistência: 54,06% Sharpe (risco/retorno): -0,10 Risco: 18,76%

**■ GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES**

Rentab. absoluta: 54,24% Rentab. relativa: 36,94 p.p. Consistência: 55,47% Sharpe (risco/retorno): 0,33 Risco: 17,38%

**■ BNP PARIBAS ACTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO AÇÕES**

Rentab. absoluta: 85,99% Rentab. relativa: 68,69 p.p. Consistência: 74,42% Sharpe (risco/retorno): 1,05 Risco: 9,55%



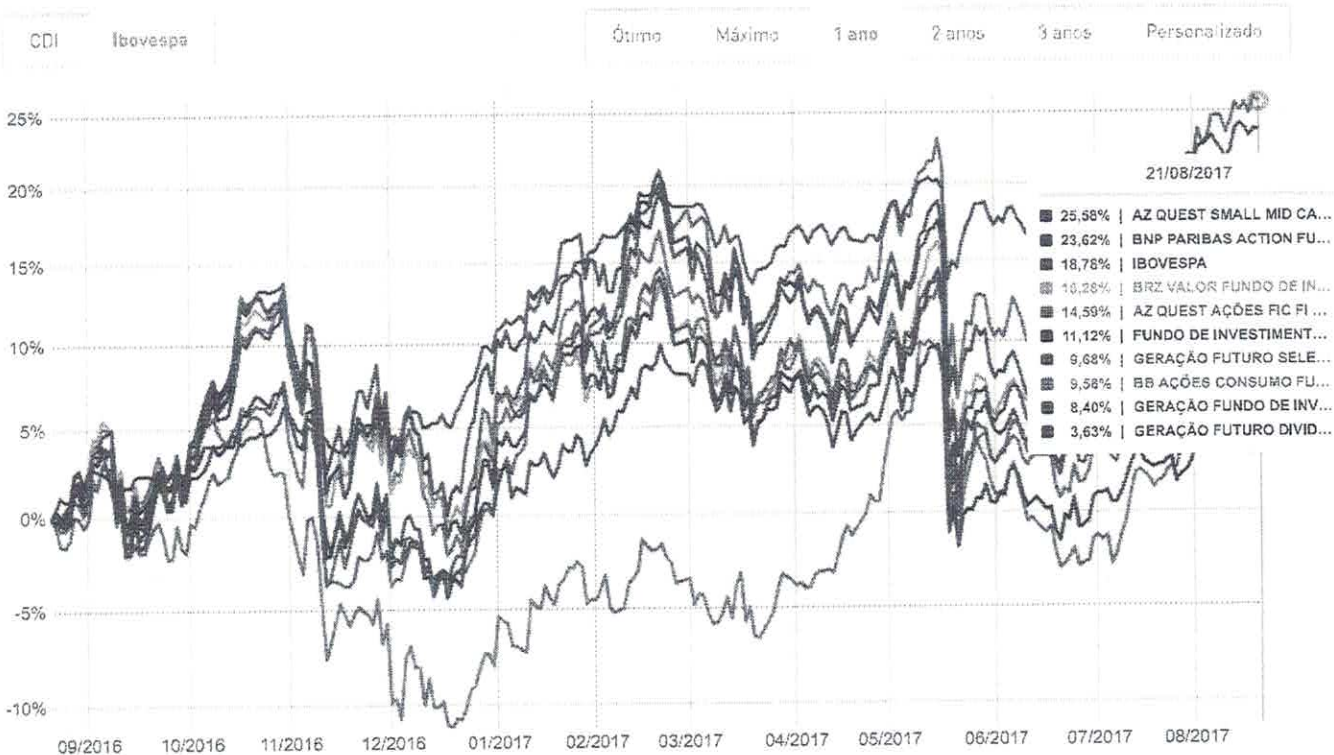
Comparação de Fundos é uma ferramenta gratuita criada pela Vérios Investimentos para ajudar pessoas a obter informações sobre mais de 15 mil fundos de investimento de forma simples e prática, contribuindo para aumentar a transparência no mercado financeiro brasileiro. Os dados apresentados são fornecidos pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM). Veja o conteúdo completo sobre fundos de investimento.



Comparação de fundos

Busque por nome ou CNPJ de fundos para incluir na comparação

Rentabilidade Underwater Volatilidade Correlação



IBOVESPA

Rentab. absoluta: 18,78% Rentab. relativa: 0,00 p.p. Consistência: N/A Sharpe (risco/retorno): N/A Risco: 21,69%

AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES

Rentab. absoluta: 25,58% Rentab. relativa: 6,79 p.p. Consistência: N/A Sharpe (risco/retorno): 0,33 Risco: 20,90%

AZ QUEST AÇÕES FIC FI DE AÇÕES

Rentab. absoluta: 14,59% Rentab. relativa: -4,20 p.p. Consistência: N/A Sharpe (risco/retorno): -0,20 Risco: 20,89%

BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

Rentab. absoluta: 9,58% Rentab. relativa: -9,20 p.p. Consistência: N/A Sharpe (risco/retorno): -0,49 Risco: 18,78%

BRZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES

Rentab. absoluta: 16,28% Rentab. relativa: -2,50 p.p. Consistência: N/A Sharpe (risco/retorno): -0,13 Risco: 19,24%

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS

Rentab. absoluta: 11,12% Rentab. relativa: -7,66 p.p. Consistência: N/A Sharpe (risco/retorno): -0,44 Risco: 17,62%

GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES

Rentab. absoluta: 8,40% Rentab. relativa: -10,39 p.p. Consistência: N/A Sharpe (risco/retorno): -0,48 Risco: 21,81%

GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES

Rentab. absoluta: 3,63% Rentab. relativa: -15,15 p.p. Consistência: N/A Sharpe (risco/retorno): -0,76 Risco: 20,04%

GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES

Rentab. absoluta: 9,68%

Rentab. relativa: -9,10 p.p.

Consistência: N/A

Sharpe (risco/retorno): -0,43

Risco: 21,27%

**BNP PARIBAS ACTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO AÇÕES**

Rentab. absoluta: 23,62%

Rentab. relativa: 4,83 p.p.

Consistência: N/A

Sharpe (risco/retorno): 0,51

Risco: 9,47%



Comparação de Fundos é uma ferramenta gratuita criada pela Vérios Investimentos para ajudar pessoas a obter informações sobre mais de 15 mil fundos de investimento de forma simples e prática, contribuindo para aumentar a transparência no mercado financeiro brasileiro. Os dados apresentados são fornecidos pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM). Veja o conteúdo completo sobre fundos de investimento.



Comparação de fundos

Busque por nome ou CNPJ de fundos para incluir na comparação

Rentabilidade Underwater Volatilidade Correlação

CDI Ibovespa

Ótimo Máximo 1 ano 2 anos 3 anos Personalizado



■ IBOVESPA

Rentab. absoluta: 50,12% Rentab. relativa: 0,00 p.p. Consistência: N/A Sharpe (risco/retorno): N/A Risco: 24,79%

■ AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES

Rentab. absoluta: 54,50% Rentab. relativa: 4,38 p.p. Consistência: 36,29% Sharpe (risco/retorno): 0,09 Risco: 18,96%

■ AZ QUEST AÇÕES FIC FI DE AÇÕES

Rentab. absoluta: 35,18% Rentab. relativa: -14,94 p.p. Consistência: 0,00% Sharpe (risco/retorno): -0,30 Risco: 21,06%

■ BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

Rentab. absoluta: 25,55% Rentab. relativa: -24,57 p.p. Consistência: 0,00% Sharpe (risco/retorno): -0,53 Risco: 19,63%

■ BRZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES

Rentab. absoluta: 37,02% Rentab. relativa: -13,10 p.p. Consistência: 0,81% Sharpe (risco/retorno): -0,29 Risco: 18,64%

■ FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS

Rentab. absoluta: 29,77% Rentab. relativa: -20,35 p.p. Consistência: 0,00% Sharpe (risco/retorno): -0,51 Risco: 16,91%

GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES							
Rentab. absoluta: 10,58%	Rentab. relativa: -39,54 p.p.	Consistência: 2,42%	Sharpe (risco/retorno): -0,80	Risco: 21,70%			
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES							
Rentab. absoluta: 0,47%	Rentab. relativa: -49,65 p.p.	Consistência: 0,00%	Sharpe (risco/retorno): -1,05	Risco: 21,16%			
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES							
Rentab. absoluta: 19,98%	Rentab. relativa: -30,14 p.p.	Consistência: 4,84%	Sharpe (risco/retorno): -0,62	Risco: 21,07%			
BNP PARIBAS ACTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO AÇÕES							
Rentab. absoluta: 50,59%	Rentab. relativa: 0,47 p.p.	Consistência: 31,05%	Sharpe (risco/retorno): 0,02	Risco: 10,78%			

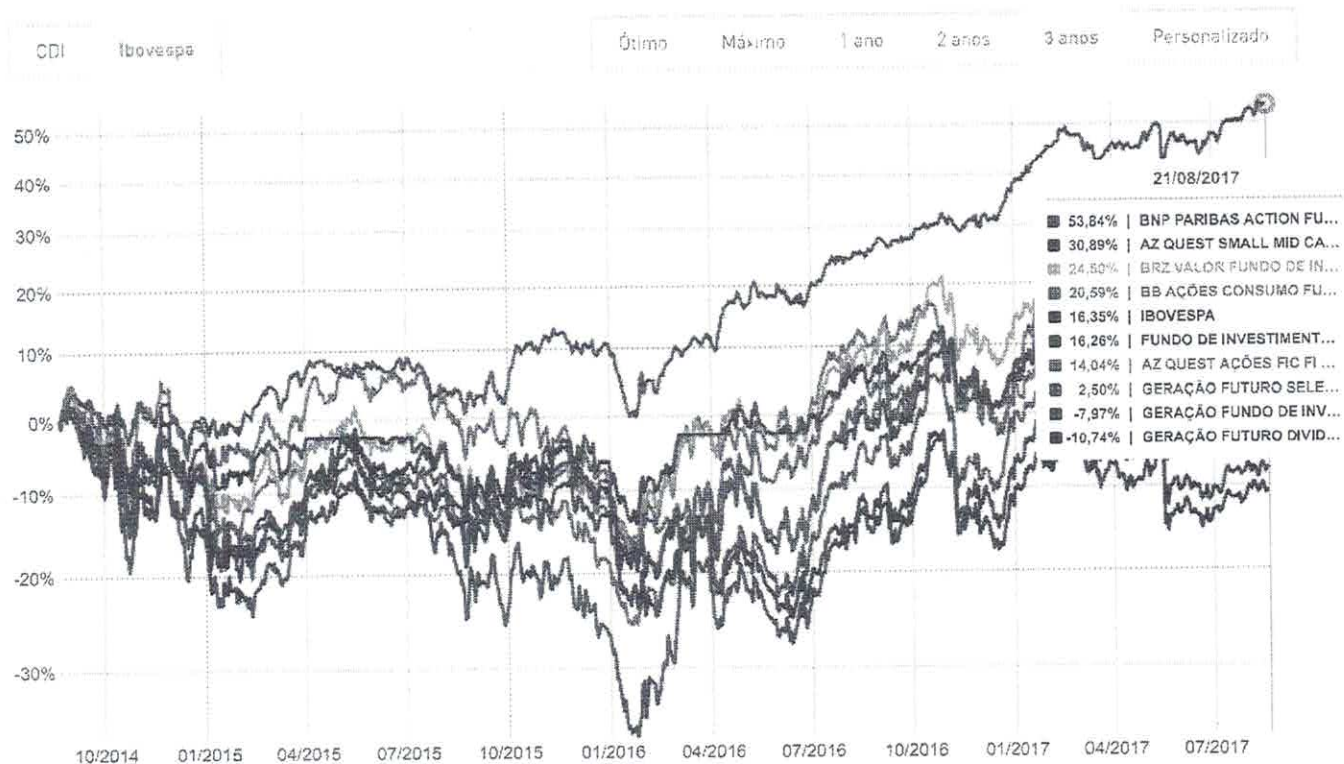
Comparação de Fundos é uma ferramenta gratuita criada pela Vérios Investimentos para ajudar pessoas a obter informações sobre mais de 15 mil fundos de investimento de forma simples e prática, contribuindo para aumentar a transparência no mercado financeiro brasileiro. Os dados apresentados são fornecidos pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM). Veja o conteúdo completo sobre fundos de investimento.



Comparação de fundos

Busque por nome ou CNPJ de fundos para incluir na comparação

Rentabilidade Underwater Volatilidade Correlação



IBOVESPA

Rentab. absoluta: 16,35%

Rentab. relativa: 0,00 p.p.

Consistência: N/A

Sharpe (risco/retorno): N/A

Risco: 25,26%

AZ QUEST SMALL MID CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES

Rentab. absoluta: 30,89%

Rentab. relativa: 14,54 p.p.

Consistência: 67,74%

Sharpe (risco/retorno): 0,24

Risco: 17,68%

AZ QUEST AÇÕES FIC FI DE AÇÕES

Rentab. absoluta: 14,04%

Rentab. relativa: -2,30 p.p.

Consistência: 27,62%

Sharpe (risco/retorno): -0,03

Risco: 20,48%

BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

Rentab. absoluta: 20,59%

Rentab. relativa: 4,24 p.p.

Consistência: 33,87%

Sharpe (risco/retorno): 0,07

Risco: 19,38%

BRZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES

Rentab. absoluta: 24,50%

Rentab. relativa: 8,15 p.p.

Consistência: 46,37%

Sharpe (risco/retorno): 0,13

Risco: 18,70%

FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS

Rentab. absoluta: 16,26%

Rentab. relativa: -0,08 p.p.

Consistência: 45,56%

Sharpe (risco/retorno): -0,00

Risco: 16,50%

GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES

Rentab. absoluta: -7,97%

Rentab. relativa: -24,32 p.p.

Consistência: 29,23%

Sharpe (risco/retorno): -0,37

Risco: 21,63%

GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES

Rentab. absoluta: -10,74%

Rentab. relativa: -27,09 p.p.

Consistência: 27,82%

Sharpe (risco/retorno): -0,42

Risco: 21,40%

GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES

Rentab. absoluta: 2,50%

Rentab. relativa: -13,85 p.p.

Consistência: 32,26%

Sharpe (risco/retorno): -0,21

Risco: 20,39%

**BNP PARIBAS ACTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO AÇÕES**

Rentab. absoluta: 53,84%

Rentab. relativa: 37,50 p.p.

Consistência: 65,12%

Sharpe (risco/retorno): 0,94

Risco: 10,88%



Comparação de Fundos é uma ferramenta gratuita criada pela Vérios Investimentos para ajudar pessoas a obter informações sobre mais de 15 mil fundos de investimento de forma simples e prática, contribuindo para aumentar a transparência no mercado financeiro brasileiro. Os dados apresentados são fornecidos pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM). Veja o conteúdo completo sobre fundos de investimento.

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

HORTOPREV

Resultado Mensal dos Investimentos, Disponibilidades Financeiras e Imóveis

Esta tabela demonstra o resultado final dos investimentos do Hortoprev para o mês em questão, esclarecendo o valor em R\$ da marcação a mercado mensal dos ativos, variação monetária no mês (apenas dos rendimentos), recebimentos de dividendos/amortizações/cupons de juros, rentabilidades no mês, ano e últimos 12 meses, além do risco (desvio-padrão) da série de 12 meses. Os valores de rendimento de cada conjunto de ativos (box) são as médias dos rendimentos de cada artigo de enquadramento. Inclui-se os imóveis e disponibilidades financeiras para maior transparência dos recursos eletronicamente em posse do instituto. Os artigos de enquadramento dos fundos são baseados em relatório divulgado pela Secretaria da Previdência Social. O cálculo do resultado total da carteira é feito através da somatória da multiplicação da rentabilidade mensal de cada ativo pela proporção do mesmo na carteira no fechamento do mês (valor aproximado dado as movimentações mensais).

Meta Anual (IPCA)	No Mês	No Ano	12 Meses
Resultado Hortoprev	0,73%	4,93%	8,87%
	2,27%	6,51%	9,85%

Mês/Ano Corrente

Julho-17

Artigo de Enquadramento / Ativo Financeiro	Valor Total [R\$]	Valor Mês [R\$]	Recebimentos [R\$]	Mês [%]	Ano [%]	12 Meses [%]	Risco [%]
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - Títulos Públicos	R\$ 71.942.042,66	R\$ 2.460.041,26	R\$ -	3,40%	8,09%	11,08%	1,74%
TESOURO IPCA+ 740199 (NTN-8)	R\$ 42.271.654,84	R\$ 1.727.906,46	R\$ -	4,24%	10,50%	16,23%	1,84%
TESOURO IGP+ 770100 (NIN-C)	R\$ 29.670.387,82	R\$ 732.134,80	R\$ -	2,53%	5,69%	3,88%	1,63%
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - Fundos Exclusivos de Títulos Públicos	R\$ 168.776.269,36	R\$ 3.292.909,91	R\$ -	1,93%	6,58%	14,24%	0,72%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 23.218.305,24	R\$ 883.710,14	R\$ -	3,96%	9,52%	14,73%	1,75%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 70.582.133,79	R\$ 740.649,46	R\$ -	1,06%	7,23%	13,20%	0,13%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 10.633.333,06	R\$ 173.176,46	R\$ -	1,64%	7,23%	11,97%	0,41%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 43.070.229,35	R\$ 1.014.572,94	R\$ -	2,41%	8,28%	13,54%	0,56%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 21.272.067,92	R\$ 480.800,91	R\$ -	2,31%	10,63%	17,77%	0,74%
Art. 7o, Inciso III, Alínea A - Fundo de RF ou Referenciado (IMA/IDKA)	R\$ 25.092.747,00	R\$ 767.800,02	R\$ -	2,13%	2,74%	3,33%	2,54%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 12.793.924,90	R\$ 493.010,53	R\$ -	4,01%	9,69%	15,18%	1,76%
BRAI FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.440.093,67	R\$ 88.563,82	R\$ -	3,77%	8,09%	15,08%	5,11%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$ 1.411.814,63	R\$ 11.731,59	R\$ -	0,84%	9,57%	15,08%	1,74%
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 1.211.917,46	R\$ 36.886,18	R\$ -	3,14%	8,90%	14,68%	1,16%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 641.516,32	R\$ 9.064,30	R\$ -	1,43%	6,23%	10,83%	0,99%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 2.324.509,41	R\$ 50.181,52	R\$ -	2,21%	4,92%	9,98%	0,67%
IME REC IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA	R\$ 4.268.970,61	R\$ 78.362,08	R\$ -	-0,46%	-12,01%	-23,84%	6,34%
Art. 7o, Inciso IV, Alínea A - Fundo de Renda Fixa	R\$ 44.494.074,95	R\$ 355.597,67	R\$ -	0,81%	6,56%	12,68%	0,15%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 44.494.074,95	R\$ 355.597,67	R\$ -	0,81%	6,56%	12,68%	0,15%
Art. 7o, Inciso VI - FIDC Cola Senlor (Aberto)	R\$ 1.905.179,15	R\$ 18.049,70	R\$ -	0,96%	-6,58%	-61,58%	14,64%
LEME MULTISEGURAR IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	R\$ 1.905.179,15	R\$ 18.049,70	R\$ -	0,96%	-6,58%	-61,58%	14,64%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC Cola Senlor (Fechado)	R\$ 2.325.816,56	-R\$ 15.188,35	R\$ 5.001,71	-2,91%	-15,29%	-14,04%	3,94%
FIDC IREDBANK BANCO DE FOMENTO - MULTISEGURAR SR2	R\$ 37.745,36	-R\$ 1.484,97	R\$ -	-3,79%	-19,74%	-17,66%	7,24%
FIDC IREDBANK BANCO DE FOMENTO - MULTISEGURAR SR3	R\$ 39.907,63	-R\$ 1.570,01	R\$ -	-3,79%	-19,74%	-17,64%	4,24%
FIDC IREDBANK BANCO DE FOMENTO - MULTISEGURAR SR4	R\$ 20.071,08	-R\$ 789,63	R\$ -	-3,79%	-19,74%	-17,63%	4,18%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$ 2.228.092,49	-R\$ 11.343,74	R\$ 5.001,71	-0,28%	-1,95%	-3,24%	0,10%

