

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 (desconsiderando aplicações e resgates - apenas dos rendimentos) e rentabilidades/metar. [Este não é um registro contábil, para informações contábeis, consultar os devidos balancetes].

	No Mês	No Ano	12 Meses
Meta Atuarial (IPCA)	1,01%	8,59%	15,26%
Resultado Hortoprev	2,47%	10,04%	9,41%

Mês/Ano Corrente	julho-16					
Artigo de Enquadramento / Ativo Financeiro	Valor Total	[R\$]	Rentabilidade Mês	Mês	Ano	12 Meses
			[R\$]	[%]	[%]	[%]
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	R\$ 68.048.592,66		R\$ 1.348.376,69			
TITULOS (NTN-B)	R\$ 38.663.946,78		R\$ 1.051.525,15	2,80%	18,29%	14,58%
TITULOS (NTN-C)	R\$ 29.384.645,88		R\$ 296.851,54	1,02%	12,02%	15,43%
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	R\$ 66.087.902,04		R\$ 822.977,55			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 9.537.656,83		R\$ 232.871,27	2,50%	18,87%	20,16%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 37.808.529,66		R\$ 385.089,80	1,03%	8,44%	14,41%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 18.741.715,55		R\$ 205.016,48	1,11%	9,61%	16,02%
Art. 7o, Inciso III, Alínea A - RF Ref.	R\$ 58.623.507,05		R\$ 1.072.350,72			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 14.889.666,18		R\$ 172.984,34	1,18%	10,02%	15,88%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 30.897.804,88		R\$ 742.499,38	2,46%	18,53%	19,89%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.873.296,88		R\$ 28.141,35	0,99%	8,94%	13,02%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$ 1.226.766,38		R\$ 30.437,67	2,54%	15,90%	15,17%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 4.986.672,87		R\$ 72.778,94	1,48%	2,55%	-5,24%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 2.113.641,33		R\$ 30.474,86	1,46%	4,02%	-1,35%
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 1.056.806,38		R\$ 27.504,03	2,67%	9,29%	12,68%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 578.852,15		-R\$ 32.469,85	-5,31%	-0,62%	-0,62%
Art. 7o, Inciso IV, Alínea A - RF	R\$ 42.272.814,24		R\$ 475.980,63			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMI	R\$ 39.487.211,46		R\$ 441.349,24	1,13%	7,69%	13,85%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONG	R\$ 2.785.602,78		R\$ 34.631,39	1,26%	8,99%	13,80%
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	R\$ 6.004.080,81		R\$ 117.211,94			
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 4.958.889,48		R\$ 104.055,55	2,14%	-47,12%	-45,43%
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	R\$ 1.045.191,33		R\$ 13.156,39	1,59%	9,48%	16,64%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	R\$ 2.676.193,82		-R\$ 16.788,20			
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	R\$ 45.838,13		-R\$ 2.822,66	-5,80%	-21,01%	-30,80%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	R\$ 48.457,92		-R\$ 2.989,99	-5,81%	-21,02%	-31,35%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	R\$ 24.367,90		-R\$ 1.507,25	-5,83%	-21,03%	-31,36%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$ 2.557.529,87		-R\$ 9.468,30	-0,19%	-3,38%	-0,05%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea B - Credito Privado	R\$ 7.904.068,00		R\$ 72.912,00			
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	R\$ 7.904.068,00		R\$ 72.912,00	0,93%	8,70%	14,83%
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	R\$ 4.442.633,45		R\$ 401.059,97			

ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMEN	R\$	4.442.633,45	R\$	401.059,97	9,92%	28,45%	15,13%
Art. 8o, Inciso III - FIA	R\$	34.829.990,77	R\$	3.185.326,31			
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	2.358.706,25	R\$	209.952,62	9,77%	20,69%	5,78%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDEN	R\$	2.290.790,71	R\$	111.579,09	7,27%	16,16%	13,60%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	5.590.567,19	R\$	533.657,83	10,55%	-2,94%	-5,86%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	4.069.537,17	R\$	336.168,89	9,00%	-4,60%	-10,38%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.742.336,66	R\$	371.280,49	11,01%	-0,86%	-2,15%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	6.886.008,73	R\$	528.456,57	8,31%	22,70%	12,57%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTI	R\$	1.175.223,89	R\$	92.958,67	8,59%	22,30%	12,56%
AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$	6.753.350,89	R\$	819.421,09	13,81%	21,80%	8,33%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES	R\$	1.963.469,28	R\$	181.851,06	10,21%	21,36%	19,93%
Art. 8o, Inciso IV - FIM	R\$	12.208.448,17	R\$	105.210,89			
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$	4.375.798,70	R\$	36.107,75	0,83%	9,20%	15,38%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	R\$	2.112.291,84	R\$	19.635,02	0,94%	6,09%	12,03%
LEMÉ FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PF	R\$	5.720.357,63	R\$	49.468,12	0,87%	8,81%	-20,45%
Art. 8o, Inciso V - FIP	R\$	11.665.114,12	-R\$	15.325,50			
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICC	R\$	2.010.850,65	-R\$	2.989,11	-3,75%	-4,60%	-8,38%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	R\$	9.331.073,55	-R\$	11.991,70	-0,13%	-0,91%	-1,76%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	R\$	323.189,92	-R\$	344,69	0,68%	-0,08%	-47,65%
Art. 8o, Inciso VI - FII	R\$	11.217.740,86	R\$	83.751,87			
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$	2.613.281,29	R\$	6.218,52	0,24%	1,98%	1,41%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	R\$	312.102,90	R\$	24.345,00	9,63%	30,28%	16,22%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	R\$	2.319.000,00	R\$	243.000,00	12,56%	25,47%	28,08%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$	5.973.356,67	-R\$	189.811,65	-3,08%	5,42%	4,28%
Disponibilidades Financeiras	R\$	137.192,78	R\$	-			
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS (CONTAS CORRENTES HORTOPREV)	R\$	137.192,78	R\$	-	0,00%	0,00%	0,00%
Em enquadramento	R\$	5.318.676,79	R\$	15.042,81			
TITULOS (TDA)	R\$	1.382.045,19	R\$	1.251,21	0,09%	7,57%	5,54%
LME CREDITO PRIVADO REC FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$	3.936.631,60	R\$	13.791,60	0,35%	3,28%	-10,32%
Imóveis	R\$	661.500,00	R\$	-			
IMÓVEIS (TERRENOS)	R\$	661.500,00	R\$	-	0,00%	0,00%	0,00%
Total Geral	R\$	332.098.455,56	R\$	7.668.087,68			

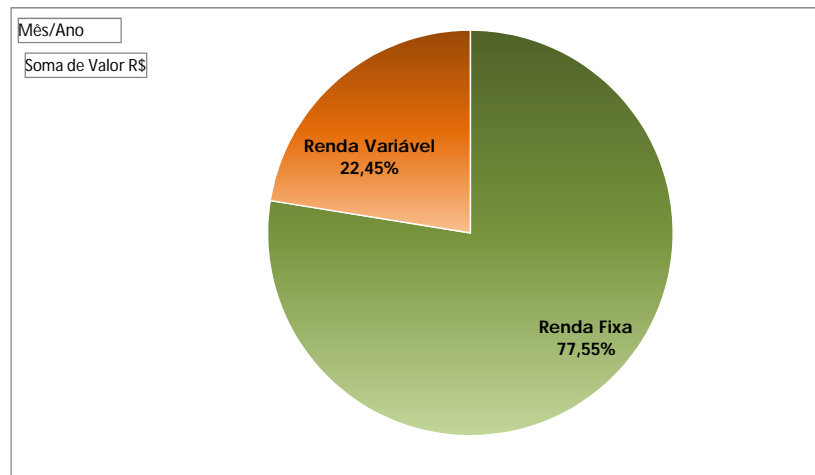
Enquadramento

Estes valores mostram se o Hortoprev está enquadrado ou não em alguns parâmetros da Resolução CMN 3922/2010.

Mês/Ano	julho-16	
Fundos	Teto 25%	Teto 20%
AQUILA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	1,44%	0,80%
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLC	5,42%	0,61%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	2,72%	2,85%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	3,01%	0,72%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	0,79%	4,55%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	3,16%	9,44%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,20%	2,91%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,51%	11,55%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTC	0,74%	12,06%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	4,17%	0,88%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMEN	2,88%	0,36%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	0,64%	0,01%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	0,68%	0,01%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	0,34%	0,01%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	0,40%	0,10%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,49%	5,73%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4,52%	1,34%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7,24%	2,41%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS	0,66%	0,70%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	2,17%	0,78%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTULO CORPORATE OFFICE FUND	0,01%	0,10%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	0,53%	0,71%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	2,44%	0,65%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1,43%	0,37%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	3,85%	1,71%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1,58%	1,24%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	5,35%	1,14%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	0,95%	1,36%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVA	14,12%	1,75%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,79%	1,52%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	2,58%	1,51%
OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD	0,26%	0,32%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	20,35%	2,10%
TITULOS (NTN-B)	0,00%	11,81%
TITULOS (NTN-C)	0,00%	8,98%
TITULOS (TDA)	0,00%	0,42%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,47%	0,65%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	18,52%	1,82%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PI	1,47%	0,85%
AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	5,12%	2,06%
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	2,06%	0,32%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,52%	0,18%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES	1,62%	0,60%

Situação: **Enquadrado** **Enquadrado**

Mês/Ano	julho-16		
Tipo	Soma de Valor R\$	%	Enquadramento
Renda Fixa	R\$ 256.935.835,41	77,55%	Enquadrado
Renda Variável	R\$ 74.363.927,37	22,45%	Enquadrado
Total Geral	R\$ 331.299.762,78	100,0%	Enquadrado



Mês/Ano	julho-16		
Artigos Resolução CMN 3922/2010	% Total	3922/2010	Situação
Art. 7o, Inciso I, Alinea A - TP SELIC	20,54%	100,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso I, Alinea B - FI TP	19,95%	100,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso III, Alinea A - RF Ref.	17,70%	80,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso IV, Alinea A - RF	12,76%	30,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	1,81%	15,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VII, Alinea A - FIDC (Fechado)	0,81%	5,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VII, Alinea B - Credito Priv:	2,39%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	1,34%	30,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso III - FIA	10,51%	15,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso IV - FIM	3,69%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso V - FIP	3,52%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso VI - FII	3,39%	5,00%	Enquadrado
Em enquadramento	1,61%	0,00%	Em Enquadram.

Limite 15% PL (Soma Art. ° VI e VII) **Art. 7° § 5°** **Enquadrado**

Provisão para Boletins de Subscrição:

Fundo	Total Boletim	Data	Não utilizado
FIP BRASIL ÓLEO E GÁS	R\$ 2.000.000,00	jun-12	R\$ 1.320.000,00

Credenciamento

Abaixo se encontra a lista de instituições financeiras que foram credenciadas pelo Hortoprev, bem como data e validade de seu credenciamento.

Instituição Financeira	CNPJ	Situação	Data do Credenciamento	Validade Credenciamento	Processo	Situação Processo
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S/A	276526840001-62	CRENCIADO	24/02/2016	22/08/2016	279/2015	Concluído
ITAÚ UNIBANCO S.A.	607011900001-04	CRENCIADO	21/03/2016	17/09/2016	137/2016	Concluído
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA	074372410001-41	CRENCIADO	29/03/2016	25/09/2016	146/2016	Concluído
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	072508640001-00	CRENCIADO	30/03/2016	26/09/2016	148/2016	Concluído
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	308229360001-69	CRENCIADO	15/04/2016	12/10/2016	191/2016	Concluído
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	003603050001-04	CRENCIADO	12/07/2016	08/01/2017	259/2016	Concluído
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	109178350001-64	CRENCIADO	08/08/2016	04/02/2017	368/2016	Concluído