

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/metasp. [Este não é um registro contábil, para informações contábeis, consultar os devidos balancetes].

	Out/16	No Ano	12 Meses
Meta Atuarial (IPCA)	0,75%	11,04%	14,35%
Resultado Hortoprev	1,42%	13,70%	15,24%

Mês/Ano Corrente	outubro-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\$ 67.904.812,67	-R\$	776.107,42			
TITULOS (NTN-B)	R\$ 39.061.379,22	R\$	187.759,47	2,67%	24,64%	27,34%
TITULOS (NTN-C)	R\$ 28.843.433,45	-R\$	963.866,89	-3,23%	9,95%	13,84%
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	R\$ 83.175.533,26	R\$	644.629,05			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 9.833.939,52	R\$	60.914,10	0,62%	22,56%	25,65%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 34.927.367,96	R\$	362.592,96	0,94%	12,02%	14,50%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 19.304.489,06	R\$	82.374,21	0,43%	12,90%	15,70%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 9.087.237,73	R\$	116.248,79	1,30%	20,74%	22,56%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 10.022.498,99	R\$	22.498,99	0,22%	6,48%	9,09%
Art. 7o, Inciso III, Alínea A - RF Ref.	R\$ 60.122.370,04	R\$	63.882,22			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 15.332.635,47	R\$	67.608,72	0,44%	13,30%	16,25%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 31.919.590,17	R\$	204.993,97	0,65%	22,45%	25,55%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.616.110,19	-R\$	304.281,08	-10,42%	-0,81%	1,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$ 1.244.582,00	R\$	5.450,97	0,44%	17,58%	22,20%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 5.134.777,05	R\$	53.952,82	1,06%	5,60%	5,87%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 2.177.561,11	R\$	11.546,26	0,53%	7,17%	-0,34%
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 1.093.863,20	R\$	12.573,78	1,16%	13,13%	12,40%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 603.250,85	R\$	12.036,78	2,04%	3,57%	3,57%
Art. 7o, Inciso IV, Alínea A - RF	R\$ 43.733.033,63	R\$	456.663,14			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMI	R\$ 40.859.517,99	R\$	431.475,50	1,07%	11,43%	13,94%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONG	R\$ 2.873.515,64	R\$	25.187,64	0,88%	12,43%	14,97%
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	R\$ 4.593.571,93	-R\$	733.468,34			
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 3.507.314,38	-R\$	746.420,47	-17,55%	-62,60%	-62,63%
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	R\$ 1.086.257,55	R\$	12.952,13	1,21%	13,43%	16,34%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	R\$ 2.469.984,92	-R\$	33.114,60			
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	R\$ 50.075,83	-R\$	1.248,56	-2,43%	-13,71%	-21,63%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	R\$ 52.944,00	-R\$	1.677,96	-3,07%	-13,71%	-21,63%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	R\$ 26.627,59	-R\$	663,92	-2,43%	-13,71%	-21,63%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$ 2.340.337,50	-R\$	29.524,16	-0,23%	-4,34%	-2,44%
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	R\$ 4.842.834,74	R\$	412.421,33			
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMEN	R\$ 4.842.834,74	R\$	412.421,33	9,31%	40,02%	35,68%

Art. 8o, Inciso III - FIA	R\$ 38.457.569,51	R\$ 3.210.280,19				
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 2.419.990,28	R\$ 4.358,88	0,18%	23,82%	17,81%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDEN	R\$ 2.462.176,90	R\$ 151.135,71	6,54%	24,85%	27,53%	
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 6.382.035,63	R\$ 686.361,69	12,05%	10,80%	12,52%	
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 4.610.891,30	R\$ 436.650,96	10,46%	8,09%	7,86%	
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 4.289.420,66	R\$ 402.832,17	10,36%	13,63%	16,68%	
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 7.246.412,19	R\$ 419.539,30	6,15%	29,13%	29,58%	
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTI	R\$ 1.310.118,59	R\$ 122.970,56	10,36%	36,34%	37,59%	
AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 7.658.007,51	R\$ 805.618,06	11,76%	38,12%	31,54%	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES	R\$ 2.078.516,45	R\$ 180.812,86	9,53%	28,47%	24,45%	
Art. 8o, Inciso IV - FIM	R\$ 12.550.990,80	R\$ 134.948,70				
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 4.489.313,10	R\$ 25.013,40	0,56%	12,04%	15,26%	
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	R\$ 2.189.123,77	R\$ 71.020,69	3,35%	9,95%	13,39%	
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PF	R\$ 5.872.553,93	R\$ 38.914,61	0,67%	11,71%	5,44%	
Art. 8o, Inciso V - FIP	R\$ 11.617.968,60	-R\$ 14.579,83				
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICC	R\$ 2.001.335,01	-R\$ 2.874,09	-0,14%	-5,05%	-5,35%	
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	R\$ 9.294.480,30	-R\$ 11.405,85	-0,12%	-1,30%	-1,83%	
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	R\$ 322.153,29	-R\$ 299,89	-0,09%	-0,40%	-0,57%	
Art. 8o, Inciso VI - FII	R\$ 11.634.090,81	R\$ 79.460,87				
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$ 2.598.910,71	-R\$ 5.664,44	-0,22%	1,42%	1,13%	
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	R\$ 314.375,10	-R\$ 2.207,28	0,10%	34,52%	21,86%	
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	R\$ 2.659.960,00	R\$ 81.960,00	3,88%	47,02%	47,12%	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$ 6.060.845,00	R\$ 5.372,59	0,09%	6,96%	6,08%	
Disponibilidades Financeiras	R\$ 138.690,29					
BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 130313-3 / COMPREV	R\$ -	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 130-9 / CUSTEIO	R\$ 13.301,64	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 30300-3 / HORTOPREV	R\$ -	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 5687-1 / PATROCINIO	R\$ 281,59	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 61-2 / BENEFÍCIO	R\$ 10.279,63	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 6252-9 / CONSTRUÇÃO	R\$ -	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
CAIXA ECONOMICA FEDERAL / 4088 / 10-8	R\$ 104.629,21	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
SANTANDER / 0178 / 45-002818-8	R\$ 10.198,22	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
Em enquadramento	R\$ 5.433.715,95	R\$ 19.800,09				
TITULOS (TDA)	R\$ 1.410.587,10	R\$ 14.173,17	1,03%	12,84%	9,52%	
LME CREDITO PRIVADO REC FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 4.023.128,85	R\$ 5.626,92	0,14%	5,55%	5,59%	
Imóveis	R\$ 661.500,00					
LOTE 09 - QUADRA 6A - R. JOSE DE CAMARGO - HORTOLÂNDIA-SP	R\$ 189.000,00	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
LOTE 10 - QUADRA 6A - R. JOSE DE CAMARGO - HORTOLÂNDIA-SP	R\$ 189.000,00	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
LOTE 11 - QUADRA 6A - R. JOSE DE CAMARGO - HORTOLÂNDIA-SP	R\$ 283.500,00	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
Total Geral	R\$ 347.336.667,15	R\$ 3.464.815,40				

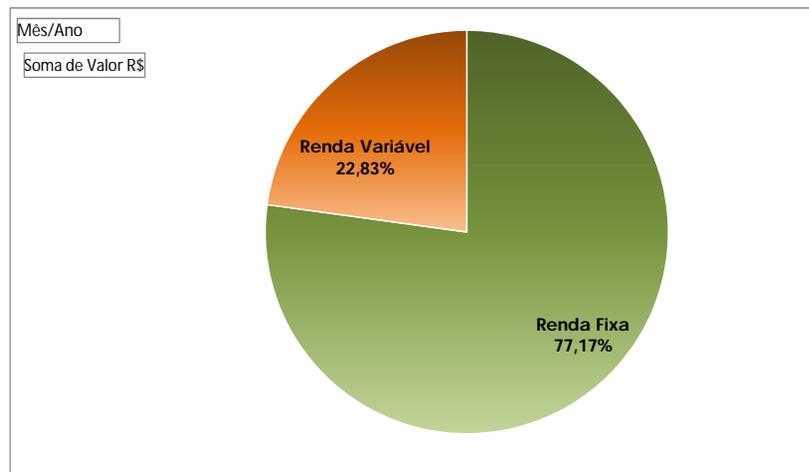
Enquadramento

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

Mês/Ano	outubro-16	
Fundos	Teto 25%	Teto 20%
	% P.L. Fundo	% Carteira
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	1,39%	0,75%
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLC	5,42%	0,58%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	2,72%	2,68%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	3,05%	0,70%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	0,69%	4,42%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	2,68%	9,21%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,17%	2,84%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,43%	10,08%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTC	0,78%	11,79%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	4,17%	0,75%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMEN	2,87%	0,38%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	0,64%	0,01%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	0,68%	0,02%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	0,34%	0,01%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	0,40%	0,09%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,44%	5,57%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4,52%	1,30%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS	0,66%	0,71%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	2,17%	0,68%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	0,01%	0,09%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	0,61%	0,77%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	1,26%	0,63%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1,41%	0,36%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	3,87%	1,84%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1,59%	1,33%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	5,37%	1,24%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	0,94%	1,40%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVA	14,12%	1,69%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,84%	1,48%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITARIOS	2,53%	1,01%
OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD	0,25%	0,31%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	18,47%	2,09%
TITULOS (NTN-B)	0,00%	11,27%
TITULOS (NTN-C)	0,00%	8,32%
TITULOS (TDA)	0,00%	0,41%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,43%	0,63%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	18,52%	1,75%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PI	1,22%	0,83%
AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	5,64%	2,21%
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,26%	0,32%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,52%	0,17%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES	1,39%	0,60%
LME CREDITO PRIVADO REC FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	12,78%	1,16%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,64%	2,62%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,46%	2,89%

Situação:	Enquadrado	Enquadrado
-----------	------------	------------

Mês/Ano	outubro-16		
Tipo	Soma de Valor R\$	%	Enquadramento
Renda Fixa	R\$ 267.433.022,40	77,17%	Enquadrado
Renda Variável	R\$ 79.103.454,46	22,83%	Enquadrado
Total Geral	R\$ 346.536.476,86	100,00%	Enquadrado



Mês/Ano	outubro-16		
Artigos Resolução CMN 3922/2010	% Total	P.A.I.	Situação
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	19,60%	100,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	24,00%	100,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso III, Alínea A - RF Ref.	17,35%	80,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso IV, Alínea A - RF	12,62%	30,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	1,33%	8,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	0,71%	2,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	1,40%	30,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso III - FIA	11,10%	15,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso IV - FIM	3,62%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso V - FIP	3,35%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso VI - FII	3,36%	5,00%	Enquadrado
Em enquadramento	1,57%	0,00%	Em Enquadram.

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

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
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	003603050001-04	CRENCIADO	12/07/2016	08/01/2017	259/2016
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	109178350001-64	CRENCIADO	08/08/2016	04/02/2017	368/2016
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	028881520001-06	CRENCIADO	01/09/2016	28/02/2017	438/2016
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	308229360001-69	CRENCIADO	27/09/2016	26/03/2017	529/2016
META ASSET MANAGEMENT LTDA	060889070001-30	CRENCIADO	25/10/2016	23/04/2017	569/2016