

Resultado Mensal dos Investimentos

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, valor das cotas, quantidade de cotas, rentabilidade no mês, proporcionalidade do total do ativo no total do patrimônio do Instituto e proporcionalidade das cotas do Instituto nos Fundos.

	novembro-15					
	Valor Total	Valor Cota	Quant. Cotas	Rent. Mes (%)	% P.L. Hortoprev	% P.L. Fundo
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	R\$ 57.979.096,97				20,40%	
TITULOS (NTN-B)	R\$ 32.205.252,25	2499,2435	12886	0,504%	11,33%	0,000%
TITULOS (NTN-C)	R\$ 25.773.844,72	3250,9895	7928	1,727%	9,07%	0,000%
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	R\$ 34.460.297,82				12,12%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 7.907.080,12	3,1345	2522582,259	1,026%	2,78%	0,188%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 11.642.111,44	1,8045	6451630,785	1,049%	4,10%	0,142%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 14.911.106,26	1,3867	10752741,54	0,505%	5,25%	0,782%
Art. 7o, Inciso III - RF Ref.	R\$ 54.525.031,84				19,18%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 10.963.737,06	11,6982	937218,9821	0,522%	3,86%	0,953%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 4.081.146,61	2,7799	1468076,091	1,018%	1,44%	0,453%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.598.309,07	188,0214	13819,21785	0,775%	0,91%	4,113%
BRASESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	R\$ 2.295.082,41	1,1580	1981851,901	0,532%	0,81%	1,831%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 24.918.514,20	1,8998	13116091,28	1,236%	8,77%	1,050%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$ 1.034.635,82	929,2881	1113,36394	1,584%	0,36%	1,927%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 4.813.407,68	1,1349	4241170,71	-0,759%	1,69%	4,793%
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 977.446,94	1,1554	845978,4768	0,437%	0,34%	2,226%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 2.842.752,05	1,4557	1952884,627	0,768%	1,00%	0,461%
Art. 7o, Inciso IV - RF	R\$ 38.758.744,59				13,64%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 8.536.533,48	1,5761	5416144,72	1,056%	3,00%	0,145%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 25.171.512,03	2,5646	9815050,647	1,052%	8,86%	0,638%
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.527.064,70	2,2076	1144721,225	1,176%	0,89%	6,887%
QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 2.523.634,38	1,3584	1857807,014	0,970%	0,89%	1,977%
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	R\$ 10.373.497,76				3,65%	
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 9.428.471,60	1,9122	4930817,18	0,455%	3,32%	2,501%
OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD	R\$ 945.026,16	261,6052	3612,41393	1,214%	0,33%	0,260%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	R\$ 2.797.620,95				0,98%	
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	R\$ 60.120,95	302,5104	198,7400901	-5,970%	0,02%	0,639%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	R\$ 63.564,45	339,8240	187,0510977	-5,970%	0,02%	0,675%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	R\$ 31.969,04	319,6904	100	-5,970%	0,01%	0,340%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$ 2.641.966,51	1,8790	1406047,362	0,120%	0,93%	2,169%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea B - Crédito Privado	R\$ 10.973.762,05				3,86%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	R\$ 7.165.048,00	1,7913	4000000	1,213%	2,52%	7,237%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 3.808.714,05	1,6460	2313974,711	-0,040%	1,34%	12,782%
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	R\$ 7.701.448,27				2,71%	
BGT PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA INSTITUCIONAL FI EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 2.746.463,53	0,9934	2764720,082	-0,628%	0,97%	11,432%

DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	R\$	1.420.580,53	0,7310	1943361,588	-1,786%	0,50%	17,552%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	3.534.404,21	1,2636	2796987,005	-0,977%	1,24%	0,817%
Art. 8o, Inciso III - FIA	R\$	31.441.193,08				11,06%	
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	1.973.997,68	1,6968	1163378,739	-3,902%	0,69%	2,444%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	R\$	2.044.483,88	1,0046	2035223,615	2,032%	0,72%	0,665%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.529.929,02	145,6942	24228,34437	2,772%	1,24%	2,552%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	2.062.786,10	1,5712	1312866,85	2,993%	0,73%	0,745%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.717.348,25	1,4035	2648620,759	3,007%	1,31%	4,958%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	7.752.537,85	1,5227	5091249,223	0,996%	2,73%	22,560%
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$	5.763.078,29	5,9794	963828,832	-1,008%	2,03%	4,498%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	1.950.426,04	1,2820	1521423,307	-0,174%	0,69%	5,199%
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	R\$	1.687.448,44	2,3209	727078,2542	1,038%	0,59%	1,710%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	959.157,53	149,8033	6402,77994	0,729%	0,34%	2,056%
Art. 8o, Inciso IV - FIM	R\$	11.084.925,61				3,90%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$	3.946.474,85	1,6794	2350000	1,323%	1,39%	4,525%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	R\$	1.957.020,93	1279,7759	1529,190304	1,368%	0,69%	3,985%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$	5.181.429,83	0,6325	8192569,391	-6,965%	1,82%	14,158%
Art. 8o, Inciso V - FIP	R\$	11.816.310,01				4,16%	
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	R\$	2.035.518,34	1017759,1690	2	-0,132%	0,72%	1,166%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	R\$	9.447.995,15	1,8896	5000000	-0,210%	3,32%	2,738%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	R\$	320.399,09	473,9631	676	-0,408%	0,11%	0,211%
VIAJA BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES*	R\$	12.397,43	0,0000	0	0,000%	0,00%	0,000%
Art. 8o, Inciso VI - FII	R\$	10.762.796,60				3,79%	
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$	2.570.531,97	1897,7882	1354,488298	0,029%	0,90%	1,439%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	R\$	325.086,90	100,1500	3246	-3,923%	0,11%	0,011%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	R\$	2.022.040,00	1011,0200	2000	3,238%	0,71%	0,468%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$	5.845.137,73	959,1405	6094,141017	1,474%	2,06%	19,111%
Em enquadramento - TP CETIP	R\$	1.547.018,43				0,54%	
TITULOS (TDA)	R\$	1.547.018,43	89,9168	17205	0,533%	0,54%	0,000%
Total Geral	R\$	284.221.743,98				100,00%	

Rentabilidade Total Carteira e Proporcional por Fundo

Esta tabela demonstra a rentabilidade total da carteira esclarecendo a rentabilidade proporcional por Fundo dentro da carteira, ou seja, o quando cada Fundo contribuiu para o resultado final da Carteira no mês.

Resultado da Carteira: 0,67%

Fundo / Ativo	Rentabilidade no Mês	% Total do Patrimônio	Contribuição para Resultado Mensal
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC			
TITULOS (NTN-B)	0,50%	11,33%	0,06%
TITULOS (NTN-C)	1,73%	9,07%	0,16%
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	1,03%	2,78%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1,05%	4,10%	0,04%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,51%	5,25%	0,03%
Art. 7o, Inciso III - RF Ref.			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	0,52%	3,86%	0,02%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	1,02%	1,44%	0,01%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,78%	0,91%	0,01%
BRANCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	0,53%	0,81%	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	1,24%	8,77%	0,11%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1,58%	0,36%	0,01%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,76%	1,69%	-0,01%
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,44%	0,34%	0,00%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,77%	1,00%	0,01%
Art. 7o, Inciso IV - RF			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	1,06%	3,00%	0,03%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	1,05%	8,86%	0,09%
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,18%	0,89%	0,01%
QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,97%	0,89%	0,01%
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)			
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	0,46%	3,32%	0,02%
OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD	1,21%	0,33%	0,00%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)			
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	-5,97%	0,02%	0,00%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	-5,97%	0,02%	0,00%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	-5,97%	0,01%	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS - FIDC PREMIUM	0,12%	0,93%	0,00%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea B - Credito Privado			
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,21%	2,52%	0,03%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,04%	1,34%	0,00%
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.			
BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA INSTITUCIONAL FI EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-0,63%	0,97%	-0,01%
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	-1,79%	0,50%	-0,01%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-0,98%	1,24%	-0,01%
Art. 8o, Inciso III - FIA			
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-3,90%	0,69%	-0,03%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	2,03%	0,72%	0,01%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	2,77%	1,24%	0,03%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	2,99%	0,73%	0,02%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	3,01%	1,31%	0,04%

QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1,00%	2,73%	0,03%
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-1,01%	2,03%	0,02%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-0,17%	0,69%	0,00%
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	1,04%	0,59%	0,01%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	0,73%	0,34%	0,00%
Art. 8o, Inciso IV - FIM			
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,32%	1,39%	0,02%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	1,37%	0,69%	0,01%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-6,97%	1,82%	-0,13%
Art. 8o, Inciso V - FIP			
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	-0,13%	0,72%	0,00%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	-0,21%	3,32%	-0,01%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	-0,41%	0,11%	0,00%
VIAJA BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES*	0,00%	0,00%	0,00%
Art. 8o, Inciso VI - FII			
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0,03%	0,90%	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	-3,92%	0,11%	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO AGENCIAS CAIXA - FII	3,24%	0,71%	0,02%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	1,47%	2,06%	0,03%
Em enquadramento - TP CETIP			
TITULOS (TDA)	0,53%	0,54%	0,00%

Retorno e Risco dos Fundos Individualmente

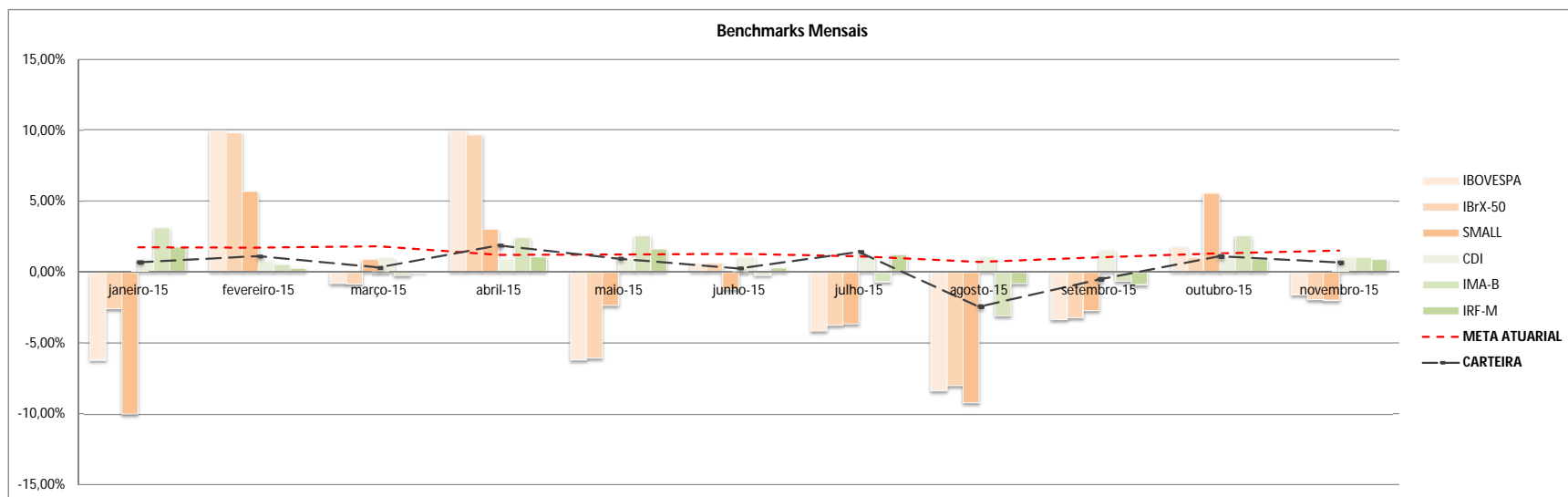
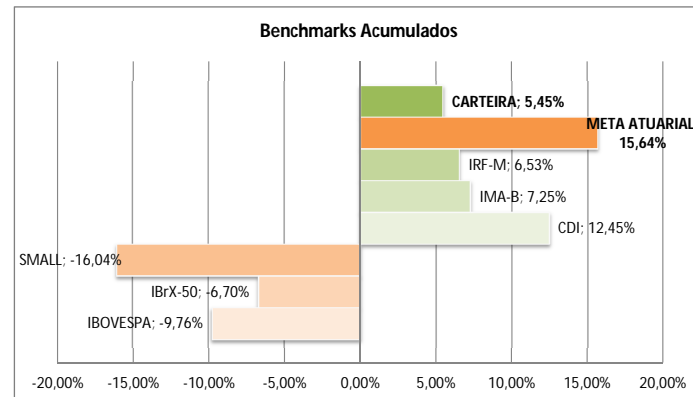
Esta tabela demonstra o retorno acumulado dos Fundos em alguns períodos, bem como sua volatilidade e índice de sharpe (relação entre volatilidade e retorno, quanto maior, melhor) e Value-at-Risk (quantidade, em porcentagem, que o Fundo pode perder em um mês em um cenário ruim, considerando seus dados seguem uma distribuição normal, quanto maior, pior).

Retorno 12 Meses	Retorno Ano	Retorno Mês	Volatilidade	Sharpe	VaR¹	Retorno Esperado	Minigráfico Retorno	Nome do Fundo
9,85%	-1,21%	0,03%	2,41%	-6,78	N/D	0,37%		AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO
-4,76%	-4,64%	-0,13%	2,06%	-10,63	N/D	0,13%		ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL
37,79%	37,92%	-0,21%	8,23%	1,47	N/D	1,63%		ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP
-13,35%	-8,03%	-3,90%	4,39%	-5,18	7,40%	0,17%		BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
11,33%	11,31%	0,52%	1,16%	-2,35	2,77%	0,87%		BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI
4,98%	7,03%	1,02%	2,34%	-0,90	4,76%	0,91%		BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO
9,41%	11,58%	1,03%	2,33%	1,17	4,92%	1,08%		BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO
12,28%	11,30%	1,05%	0,18%	-10,67	1,19%	0,89%		BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI
13,27%	12,14%	1,06%	0,12%	-0,92	1,16%	0,96%		BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
11,17%	10,23%	0,78%	0,48%	-1,99	1,71%	0,93%		BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA
12,05%	12,03%	0,53%	0,85%	-10,40	2,32%	0,92%		BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5
-10,62%	-6,39%	0,73%	3,87%	-7,63	6,22%	-0,15%		BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
-9,53%	-3,83%	-0,63%	4,66%	-6,53	7,50%	-0,15%		BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA INSTITUCIONAL FI EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES
-26,58%	-19,12%	-1,79%	4,55%	-12,81	5,82%	-1,67%		DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES
-8,01%	-8,57%	-5,97%	327,52%	-0,34	N/D	54,94%		FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2
-8,70%	-9,25%	-5,97%	27,39%	-4,52	N/D	-12,59%		FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3
-8,70%	-9,25%	-5,97%	28,04%	-4,44	N/D	-16,77%		FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4
-48,79%	-48,64%	-0,41%	29,22%	-1,02	50,59%	2,53%		FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES
13,33%	13,26%	0,51%	0,88%	1,91	2,46%	1,02%		FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO
16,25%	15,04%	1,32%	0,43%	8,45	1,80%	1,09%		FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO
15,75%	14,56%	1,21%	1,56%	8,25	3,96%	1,40%		FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO
13,10%	12,01%	1,05%	0,12%	-3,39	1,15%	0,95%		FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO
5,44%	7,29%	1,24%	2,20%	-0,83	4,55%	0,92%		FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP
-0,31%	0,21%	2,03%	3,74%	-5,02	6,46%	0,32%		FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS
5,31%	5,58%	0,12%	1,25%	-8,75	N/D	0,57%		FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM
4,35%	0,50%	-3,92%	2,78%	-9,82	N/D	-0,08%		FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND
7,38%	7,09%	3,24%	1,85%	0,96	N/D	1,04%		FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO AGENCIAS CAIXA - FII
12,19%	11,60%	1,37%	0,46%	-2,27	1,68%	0,93%		FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO
-0,52%	0,46%	1,58%	1,84%	-11,57	3,19%	0,16%		FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B
-5,33%	2,17%	2,77%	5,25%	-3,95	8,93%	0,30%		GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
-3,84%	5,08%	2,99%	5,05%	-2,13	8,99%	0,69%		GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
-6,09%	-1,26%	3,01%	4,77%	-4,17	8,16%	0,31%		GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
13,73%	15,58%	1,18%	0,75%	1,87	2,25%	1,01%		INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA
-13,52%	-7,44%	-0,98%	5,01%	-6,82	7,93%	-0,31%		ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
-7,19%	-7,41%	-0,04%	2,86%	-7,76	4,85%	0,15%		LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO
-24,11%	-22,05%	-6,97%	6,37%	-6,15	9,99%	-0,49%		LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO
-5,25%	-1,09%	-0,76%	2,19%	-7,25	3,99%	0,39%		LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
16,76%	15,19%	0,46%	0,37%	18,04	1,81%	1,19%		LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS
13,82%	14,60%	0,44%	1,56%	0,48	3,57%	1,00%		LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA
15,08%	13,83%	1,21%	0,14%	24,90	1,31%	1,08%		OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD
-10,49%	-7,16%	1,00%	3,96%	-7,25	6,41%	-0,11%		QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
-13,79%	-8,19%	-1,01%	4,81%	-6,70	7,68%	-0,23%		QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES
-8,00%	-2,54%	1,04%	4,60%	-6,65	7,40%	-0,16%		AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES
10,21%	9,87%	0,97%	0,33%	-9,57	1,39%	0,85%		QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO
9,75%	10,09%	0,77%	0,93%	-2,23	2,43%	0,89%		TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5
5,27%	4,86%	1,47%	1,54%	-7,63	3,07%	0,54%		VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO
-16,36%	-11,37%	-0,17%	4,31%	-8,57	6,61%	-0,48%		WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
17,11%	15,64%	1,50%	0,33%	17,70	N/A	1,16%		META ATUARIAL (IPCA + 6%)
13,53%	12,45%	1,06%	0,18%	0,00	N/A	0,96%		CDI (ATIVO LIVRE DE RISCO)

Comportamento dos Índices

Estes dados demonstram o comportamento do mercado em seus principais indicadores (benchmarks) ao decorrer do ano e compara a Meta Atuarial e a Carteira de Investimentos do Hortoprev com estes.

MÊS	IBOVESPA	IBrX-50	SMALL	CDI	IMA-B	IRF-M	META ATUARIAL	CARTEIRA
janeiro-15	-6,20%	-2,60%	-9,96%	0,93%	3,12%	1,79%	1,73%	0,68%
fevereiro-15	9,97%	9,81%	5,68%	0,82%	0,54%	0,29%	1,71%	1,12%
março-15	-0,84%	-0,88%	0,92%	1,04%	-0,28%	-0,03%	1,81%	0,32%
abril-15	9,93%	9,66%	3,04%	0,95%	2,44%	1,09%	1,20%	1,88%
maio-15	-6,17%	-6,05%	-2,37%	0,98%	2,57%	1,63%	1,23%	0,93%
junho-15	0,61%	0,64%	-1,24%	1,06%	-0,27%	0,32%	1,28%	0,24%
julho-15	-4,17%	-3,75%	-3,66%	1,18%	-0,73%	1,23%	1,11%	1,42%
agosto-15	-8,33%	-7,98%	-9,16%	1,11%	-3,11%	-0,85%	0,71%	-2,45%
setembro-15	-3,36%	-3,24%	-2,73%	1,57%	-0,68%	-0,94%	1,03%	-0,53%
outubro-15	1,80%	1,05%	5,54%	1,11%	2,58%	0,92%	1,31%	1,10%
novembro-15	-1,63%	-1,98%	-2,03%	1,06%	1,03%	0,92%	1,50%	0,67%
dezembro-15								
Acumulado	-9,76%	-6,70%	-16,04%	12,45%	7,25%	6,53%	15,64%	5,45%
Média	-0,76%	-0,48%	-1,45%	1,07%	0,66%	0,58%	1,33%	0,49%
Volatilidade	6,11%	5,70%	5,15%	0,19%	1,91%	0,91%	0,34%	1,17%

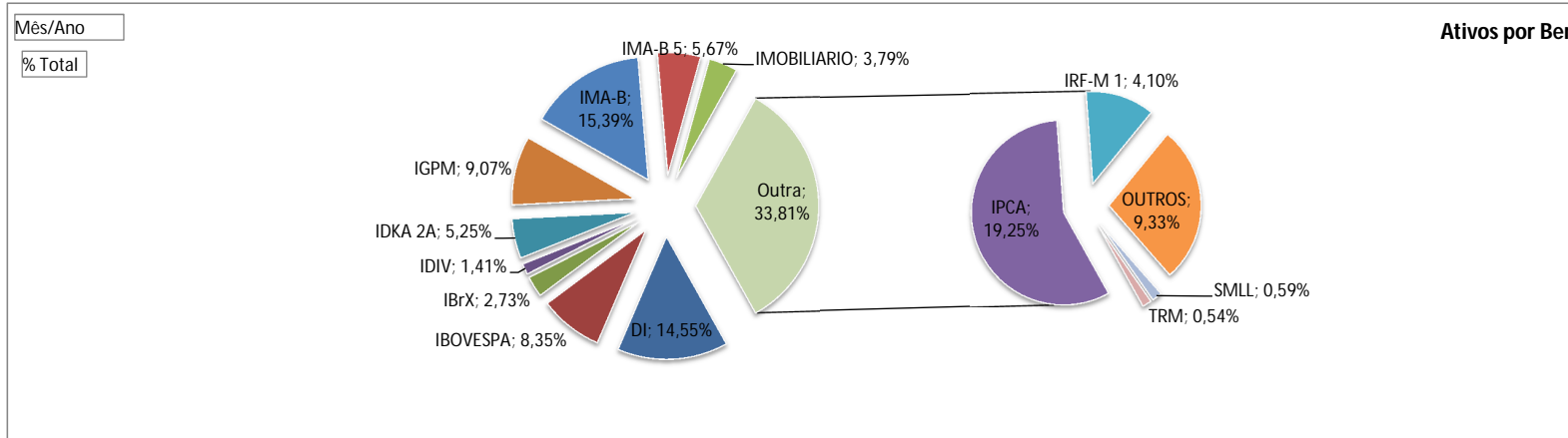


Distribuição da Alocação dos Ativos

Este gráfico demonstra qual a proporção dos ativos do Hortoprev frente aos principais índices de referência do mercado.

Mês/Ano novembro-15

BENCHMARK	% Total
DI	14,55%
IBOVESPA	8,35%
IBrX	2,73%
IDIV	1,41%
IDKA 2A	5,25%
IGPM	9,07%
IMA-B	15,39%
IMA-B 5	5,67%
IMOBILIARIO	3,79%
IPCA	19,25%
IRF-M 1	4,10%
OUTROS	9,33%
SMLL	0,59%
TRM	0,54%
Total Geral	100,00%

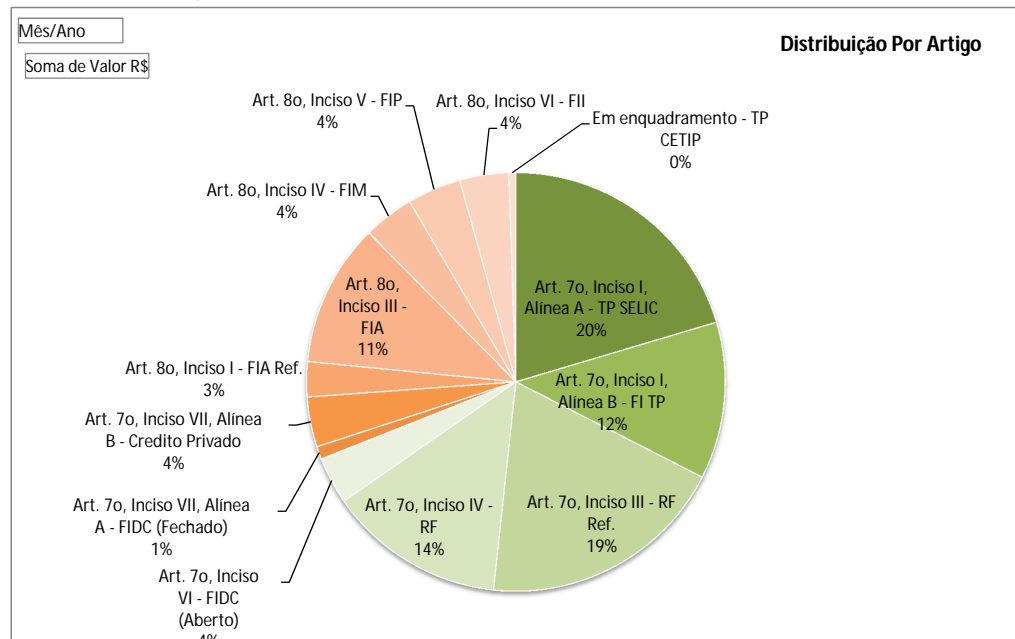


Enquadramento

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

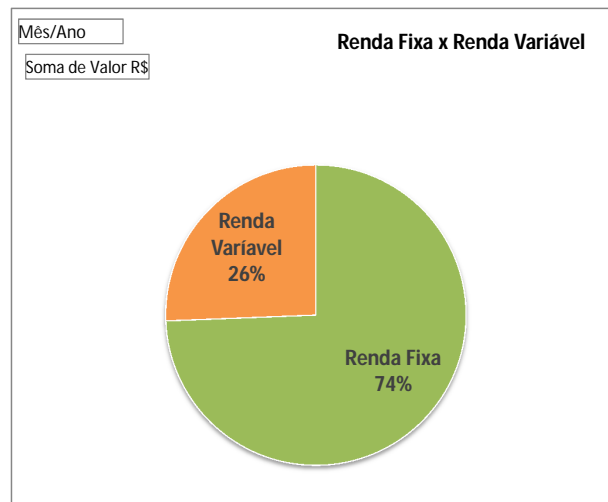
Mês/Ano	nov/15				
Artigos Resolução CMN 3922/2010	Soma de Valor R\$	P.A.I	Resultado	Sobra*	
Art. 7o, Inciso I, Alinea A - TP SELIC	20,40%	100,00%	Enquadrado	R\$	226.242.647,01
Art. 7o, Inciso I, Alinea B - FI TP	12,12%	100,00%	Enquadrado	R\$	249.761.446,16
Art. 7o, Inciso III - RF Ref.	19,18%	80,00%	Enquadrado	R\$	172.852.363,34
Art. 7o, Inciso IV - RF	13,64%	30,00%	Enquadrado	R\$	46.507.778,60
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	3,65%	8,00%	Enquadrado	R\$	12.364.241,76
Art. 7o, Inciso VII, Alinea A - FIDC (Fechado)	0,98%	2,00%	Enquadrado	R\$	2.886.813,93
Art. 7o, Inciso VII, Alinea B - Credito Privado	3,86%	5,00%	Enquadrado	R\$	3.237.325,15
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	2,71%	30,00%	Enquadrado	R\$	77.565.074,92
Art. 8o, Inciso III - FIA	11,06%	15,00%	Enquadrado	R\$	11.192.068,52
Art. 8o, Inciso IV - FIM	3,90%	5,00%	Enquadrado	R\$	3.126.161,59
Art. 8o, Inciso V - FIP	4,16%	5,00%	Enquadrado	R\$	2.394.777,19
Art. 8o, Inciso VI - FII	3,79%	5,00%	Enquadrado	R\$	3.448.290,60
Em enquadramento - TP CETIP	0,54%	0,00%	Em enquadramento	-R\$	1.547.018,43

*Valor que falta para chegar ao Limite



Mês/Ano: novembro-15

Rótulos de Linha	Soma de Valor R\$	%	Resultado
Renda Fixa	R\$ 211.415.070,41	74,38%	Enquadrado
Renda Variável	R\$ 72.806.673,57	25,62%	Enquadrado
Total Geral	R\$ 284.221.743,98	100,00%	



Enquadramentos Extras:

Lim. 20% PL por Fundo (Aplica 7º III, IV e 8º I)	Art. 13º	Consultar "Resultados Mês"
--	----------	----------------------------

Lim. 25% PL do Fundo (Aplica todos)	Art. 13º	Consultar "Resultados Mês"
---	----------	----------------------------

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

Evolução do Patrimônio, Aplicações e Resgates

Estes dados demonstram a evolução do patrimônio do Instituto e e quais foram as movimentações de aplicações ou resgates no período.

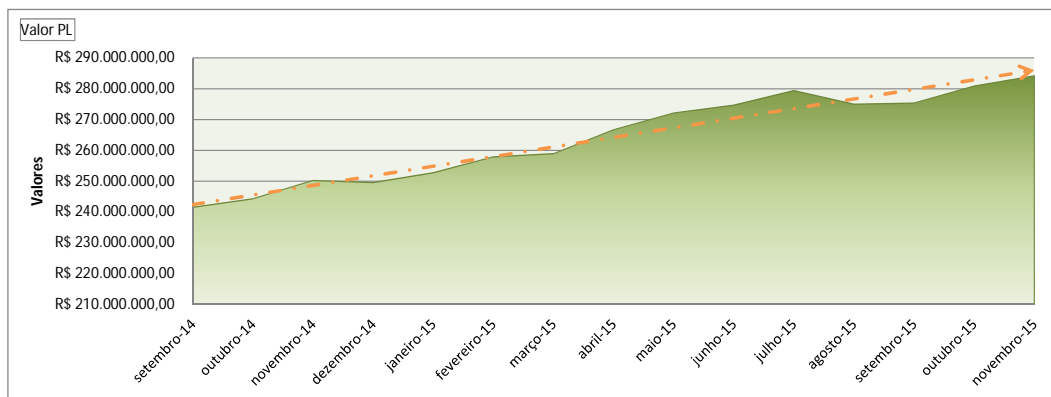
Patrimônio

Meses	Valor PL
setembro-14	R\$ 241.554.531,70
outubro-14	R\$ 244.287.758,15
novembro-14	R\$ 250.246.295,65
dezembro-14	R\$ 249.557.263,70
janeiro-15	R\$ 252.753.975,93
fevereiro-15	R\$ 257.885.905,48
março-15	R\$ 258.949.052,86
abril-15	R\$ 266.721.381,41
maio-15	R\$ 272.105.635,73
junho-15	R\$ 274.677.926,25
julho-15	R\$ 279.420.082,65
agosto-15	R\$ 275.011.564,06
setembro-15	R\$ 275.348.227,23
outubro-15	R\$ 280.874.005,62
novembro-15	R\$ 284.221.743,98

Aplicações e Resgates

Ano	2.015
Mês	11

Tabela Resumida de Aplicações e Resgates		
Fundo	Aplicação	Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 3.550.000,00	R\$ 1.515.126,75
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	R\$ 4.000,00	
Total Geral	R\$ 3.554.000,00	R\$ 1.515.126,75



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
LEME INVESTIMENTOS LTDA	741989120001-56	CRENCIADO	01/07/2015	28/12/2015
J. SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA	621800470001-31	CRENCIADO	31/07/2015	27/01/2016
JS ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS S.A.	438268330001-19	CRENCIADO	31/07/2015	27/01/2016
ITAÚ UNIBANCO S.A.	607011900001-04	CRENCIADO	14/08/2015	10/02/2016
EQUITAS ADMINISTRAÇÃO DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS LTDA	082048170001-93	CRENCIADO	03/09/2015	01/03/2016
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA	074372410001-41	CRENCIADO	09/09/2015	07/03/2016
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	072508640001-00	CRENCIADO	15/09/2015	13/03/2016
FMD GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	104461310001-50	CRENCIADO	25/09/2015	23/03/2016
INFINITY ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	034031810001-95	CRENCIADO	01/10/2015	29/03/2016
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	308229360001-69	CRENCIADO	06/10/2015	03/04/2016
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	623751340001-44	CRENCIADO	14/10/2015	11/04/2016
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	028881520001-06	CRENCIADO	16/10/2015	13/04/2016
TERCON INVESTIMENTOS LTDA	091214540001-95	CRENCIADO	21/10/2015	18/04/2016
J. MALUCELLI DTVM LTDA.	766214570001-85	CRENCIADO	22/10/2015	19/04/2016
RIO BRAVO INVESTIMENTOS DTVM LTDA	726000260001-81	CRENCIADO	26/10/2015	23/04/2016
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	038646070001-08	CRENCIADO	26/10/2015	23/04/2016
FOCO DTVM LTDA.	003295980001-67	CRENCIADO	03/11/2015	01/05/2016
GENUS CAPITAL GROUP GESTAO DE RECURSOS LTDA	101723640001-02	CRENCIADO	09/11/2015	07/05/2016
AQUILLA ASSET MANAGEMENT	089645450001-20	CRENCIADO	10/11/2015	08/05/2016