

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

	Nov/16	No Ano	12 Meses
Meta Atuarial (IPCA)	0,67%	11,78%	13,41%
Resultado Hortoprev	-1,55%	11,94%	12,69%

Mês/Ano Corrente	novembro-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\$ 66.956.166,94	-R\$	948.645,73			
TITULOS (NTN-B)	R\$ 38.313.438,08	-R\$	747.941,14	-1,09%	23,09%	25,12%
TITULOS (NTN-C)	R\$ 28.642.728,86	-R\$	200.704,59	-0,70%	9,19%	11,13%
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	R\$ 89.924.327,27	R\$	460.428,71			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 9.710.335,26	-R\$	123.604,26	-1,26%	21,02%	22,81%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 37.091.466,50	R\$	374.098,54	1,02%	13,16%	14,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 23.926.316,23	R\$	123.461,87	0,57%	13,55%	15,78%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 9.111.599,03	R\$	24.361,30	0,27%	21,07%	21,70%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 10.084.610,25	R\$	62.111,26	0,62%	13,84%	16,22%
Art. 7o, Inciso III, Alínea A - RF Ref.	R\$ 58.958.244,64	-R\$	1.164.125,40			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 15.391.432,09	R\$	58.796,62	0,38%	13,73%	16,09%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 31.533.921,02	-R\$	385.669,15	-1,21%	20,97%	22,78%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.628.963,18	R\$	12.852,99	0,49%	-0,33%	1,18%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$ 1.250.984,31	R\$	6.402,31	0,51%	18,19%	20,91%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 4.284.346,78	-R\$	850.430,27	-16,56%	-11,89%	-10,99%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 2.182.203,30	R\$	4.642,19	0,21%	7,39%	-0,89%
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 1.088.977,93	-R\$	4.885,27	-0,45%	12,62%	11,41%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 597.416,03	-R\$	5.834,82	-0,97%	2,57%	2,57%
Art. 7o, Inciso IV, Alínea A - RF	R\$ 44.156.073,87	R\$	423.040,24			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMI	R\$ 41.288.025,69	R\$	428.507,70	1,05%	12,60%	13,93%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONG	R\$ 2.868.048,18	-R\$	5.467,46	-0,19%	12,21%	13,65%
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	R\$ 4.665.819,77	R\$	72.247,84			
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 3.566.596,71	R\$	59.282,33	1,69%	-61,96%	-62,17%
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	R\$ 1.099.223,06	R\$	12.965,51	1,19%	14,78%	16,32%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	R\$ 2.442.185,45	-R\$	27.799,47			
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	R\$ 48.804,55	-R\$	1.271,28	-2,54%	-15,90%	-18,77%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	R\$ 51.599,91	-R\$	1.344,09	-2,54%	-15,90%	-18,77%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	R\$ 25.951,60	-R\$	675,99	-2,54%	-15,90%	-18,77%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$ 2.315.829,39	-R\$	24.508,11	-0,18%	-4,51%	-2,73%
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	R\$ 4.548.714,77	-R\$	294.119,97			
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMEN	R\$ 4.548.714,77	-R\$	294.119,97	-6,04%	31,57%	28,75%

Art. 8o, Inciso III - FIA	R\$	35.347.210,43	-R\$	3.110.359,08			
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	2.224.828,47	-R\$	195.161,81	-8,06%	13,84%	12,71%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDEN	R\$	2.312.353,91	-R\$	149.822,99	-6,08%	17,25%	17,39%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	5.946.698,57	-R\$	435.337,06	-6,82%	3,24%	2,01%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	4.105.046,39	-R\$	505.844,91	-10,97%	-3,77%	-6,76%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.826.412,09	-R\$	463.008,57	-10,79%	1,37%	1,05%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	6.704.639,59	-R\$	541.772,60	-7,48%	19,47%	18,71%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTI	R\$	1.216.389,74	-R\$	93.728,85	-7,15%	26,59%	26,82%
AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$	7.110.967,22	-R\$	547.040,29	-7,14%	28,25%	23,39%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES	R\$	1.899.874,45	-R\$	178.642,00	-8,59%	17,43%	12,59%
Art. 8o, Inciso IV - FIM	R\$	5.970.847,06	-R\$	2.079.762,14			
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$	-	R\$	11.068,50	0,25%	12,31%	14,04%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	R\$	2.205.821,70	R\$	16.697,93	0,76%	10,79%	12,71%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PF	R\$	3.765.025,36	-R\$	2.107.528,57	-35,89%	-28,38%	-27,34%
Art. 8o, Inciso V - FIP	R\$	11.603.425,79	-R\$	14.542,81			
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICC	R\$	1.998.506,77	-R\$	2.828,24	-0,14%	-5,18%	-5,36%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	R\$	9.283.064,40	-R\$	11.415,90	-0,12%	-1,42%	-1,75%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	R\$	321.854,62	-R\$	298,67	-0,09%	-0,50%	-0,25%
Art. 8o, Inciso VI - FII	R\$	11.422.608,95	-R\$	211.481,86			
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$	2.588.951,43	-R\$	9.959,28	-0,38%	1,03%	0,72%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	R\$	305.448,60	-R\$	8.926,50	-2,07%	31,73%	24,21%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	R\$	2.475.980,00	-R\$	183.980,00	-6,28%	37,79%	33,57%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$	6.052.228,92	-R\$	8.616,08	-0,14%	6,81%	4,39%
Disponibilidades Financeiras	R\$	271.253,77					
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\$	17.844,56	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\$	164.851,07	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\$	78.078,33	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\$	5.250.029,16	-R\$	183.686,79			
TITULOS (TDA)	R\$	1.421.675,34	R\$	11.088,24	0,85%	13,80%	13,80%
LME CREDITO PRIVADO REC FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$	3.828.353,82	-R\$	194.775,03	-4,84%	0,44%	0,52%
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\$	342.178.407,87	-R\$	7.078.806,46			

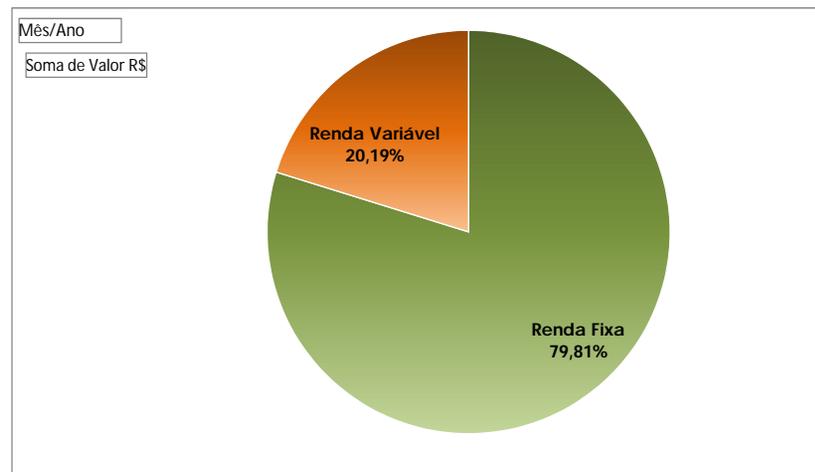
Enquadramento

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

Mês/Ano	novembro-16	
	Teto 25%	Teto 20%
Fundos	% P.L. Fundo	% Carteira
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	1,39%	0,76%
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLC	5,42%	0,59%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	2,72%	2,72%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	3,06%	0,65%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	0,75%	4,51%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	2,82%	9,24%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,18%	2,85%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,41%	10,87%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTC	0,78%	12,10%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	4,17%	0,77%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMEN	2,87%	0,36%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	0,64%	0,01%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	0,68%	0,02%
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	0,61%	7,01%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,00%	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS	0,66%	0,68%
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	0,57%	0,73%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	1,18%	0,65%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1,41%	0,37%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	3,79%	1,74%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1,58%	1,20%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	5,34%	1,12%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	0,93%	1,33%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVA	14,12%	1,10%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,79%	1,26%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	2,53%	1,05%
OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD	0,26%	0,32%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	14,45%	1,96%
TÍTULOS (NTN-B)	0,00%	11,23%
TÍTULOS (NTN-C)	0,00%	8,39%
TÍTULOS (TDA)	0,00%	0,42%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,40%	0,64%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	18,52%	1,77%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PI	1,35%	0,84%
AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	5,60%	2,08%
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,92%	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	1,38%	0,56%
LME CREDITO PRIVADO REC FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	12,78%	1,12%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,68%	2,67%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,33%	2,96%

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

Mês/Ano	novembro-16		
Tipo	Soma de Valor R\$	%	Enquadramento
Renda Fixa	R\$ 272.352.847,10	79,81%	Enquadrado
Renda Variável	R\$ 68.892.807,00	20,19%	Enquadrado
Total Geral	R\$ 341.245.654,10	100,00%	Enquadrado



Mês/Ano	nov/16		
Artigos Resolução CMN 3922/2010	% Total	P.A.I.	Situação
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	19,62%	100,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	26,35%	100,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso III, Alínea A - RF Ref.	17,28%	80,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso IV, Alínea A - RF	12,94%	30,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	1,37%	8,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	0,72%	2,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	1,33%	30,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso III - FIA	10,36%	15,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso IV - FIM	1,75%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso V - FIP	3,40%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso VI - FII	3,35%	5,00%	Enquadrado
Em enquadramento	1,54%	0,00%	Em Enquadram.

Limite 15% PL	Art. 7º § 5º	Enquadrado
(Soma Art. 6º 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