

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:

	setembro-15					
	Valor Total	Valor Cota	Quant. Cotas	Rent. Mes (%)	% P.L. Hortoprev	% P.L. Fundo
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	R\$ 56.684.181,03				20,59%	
TITULOS (NTN-B)	R\$ 31.441.134,86	2439,9453	12886	-2,082%	11,42%	0,000%
TITULOS (NTN-C)	R\$ 25.243.046,17	3184,0371	7928	0,029%	9,17%	0,000%
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	R\$ 34.172.062,72				12,41%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 7.635.979,46	3,0270	2522582,259	-0,747%	2,77%	0,176%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 1.305.003,23	3,2258	404554,7217	-1,023%	0,47%	0,075%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 10.779.857,77	1,7629	6114876,083	0,889%	3,91%	0,138%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 14.451.222,26	1,3440	10752741,54	0,906%	5,25%	0,885%
Art. 7o, Inciso III - RF Ref.	R\$ 64.809.324,02				23,54%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 10.647.759,27	11,3610	937218,9821	0,737%	3,87%	0,989%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.943.637,09	2,6863	1468076,091	-0,666%	1,43%	0,424%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.542.049,46	183,9503	13819,21785	0,512%	0,92%	3,929%
BRDESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	R\$ 2.228.678,08	1,1245	1981851,901	0,574%	0,81%	2,450%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 35.868.733,02	1,8305	19594693,46	-0,784%	13,03%	1,521%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$ 991.788,08	890,8031	1113,36394	-3,679%	0,36%	1,927%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 4.896.664,83	1,1546	4241170,71	-2,124%	1,78%	4,840%
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 931.385,96	1,1010	845978,4768	0,338%	0,34%	2,226%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 2.758.628,23	1,4126	1952884,627	0,462%	1,00%	0,531%
Art. 7o, Inciso IV - RF	R\$ 20.632.958,57				7,49%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 8.353.954,28	1,5424	5416144,72	1,122%	3,03%	0,144%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 7.337.101,18	2,5100	2923193,304	1,119%	2,66%	0,179%
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.466.879,77	2,1550	1144721,225	1,247%	0,90%	7,755%
QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 2.475.023,34	1,3322	1857807,014	0,633%	0,90%	1,919%
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	R\$ 10.181.127,92				3,70%	
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 9.259.193,45	1,8778	4930817,18	1,054%	3,36%	2,476%
OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD	R\$ 921.934,47	255,2129	3612,41393	1,275%	0,33%	0,256%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	R\$ 2.830.619,66				1,03%	
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	R\$ 65.372,88	328,9365	198,7400901	0,397%	0,02%	0,639%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	R\$ 69.117,18	369,5096	187,0510977	-0,395%	0,03%	0,675%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	R\$ 34.761,72	347,6172	100	-0,395%	0,01%	0,340%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$ 2.661.367,88	1,8928	1406047,362	0,840%	0,97%	2,129%

Art. 7o, Inciso VII, Alínea B - Credito Privado	R\$	11.281.809,51				4,10%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	R\$	7.005.084,00	1,7513	4000000	0,745%	2,54%	7,237%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	R\$	4.276.725,51	1,6492	2593151,509	-0,490%	1,55%	12,494%
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	R\$	7.716.353,49				2,80%	
BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA INSTITUCIONAL FI EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$	2.728.503,08	0,9869	2764720,082	-1,891%	0,99%	11,432%
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	R\$	1.446.308,28	0,7442	1943361,588	-4,146%	0,53%	19,972%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	3.541.542,13	1,2662	2796987,005	-1,666%	1,29%	0,790%
Art. 8o, Inciso III - FIA	R\$	30.892.683,23				11,22%	
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	2.093.639,44	1,7996	1163378,739	-0,064%	0,76%	2,358%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FI EM COTAS DE FIA	R\$	936.374,63	146,2450	6402,77994	-4,676%	0,34%	1,974%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	R\$	1.922.268,70	0,9445	2035223,615	-0,889%	0,70%	0,665%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.449.558,31	142,3770	24228,34437	2,509%	1,25%	2,477%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	2.015.316,51	1,5351	1312866,85	1,593%	0,73%	0,740%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.611.843,87	1,3637	2648620,759	2,862%	1,31%	4,906%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	7.577.499,18	1,4883	5091249,223	-5,179%	2,75%	22,259%
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$	5.796.580,62	6,0141	963828,832	-0,688%	2,11%	3,977%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	1.881.347,32	1,2366	1521423,307	-4,933%	0,68%	4,987%
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	R\$	1.608.254,65	2,2119	727078,2542	1,367%	0,58%	1,632%
Art. 8o, Inciso IV - FIM	R\$	11.865.245,10				4,31%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$	3.863.031,05	1,6438	2350000	0,732%	1,40%	4,525%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	R\$	1.902.389,00	1244,0499	1529,190304	0,565%	0,69%	4,130%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$	6.099.825,05	0,7446	8192569,391	-8,736%	2,22%	14,158%
Art. 8o, Inciso V - FIP	R\$	12.140.962,80				4,41%	
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	R\$	2.042.418,00	1021208,9995	2	-0,128%	0,74%	1,168%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	R\$	9.479.435,10	1,8959	5000000	-0,120%	3,44%	2,750%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	R\$	606.712,27	902,8456	672	-0,234%	0,22%	0,400%
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\$	10.531.794,65				3,82%	
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$	2.575.719,82	1901,6184	1354,488298	-0,133%	0,94%	1,439%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	R\$	327.846,00	101,0000	3246	-4,793%	0,12%	0,011%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	R\$	1.927.400,00	963,7000	2000	-1,149%	0,70%	0,431%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$	5.700.828,83	935,4606	6094,141017	0,475%	2,07%	19,111%
Em enquadramento - TP CETIP	R\$	1.609.104,53				0,58%	
TITULOS (TDA)	R\$	1.609.104,53	89,3649	18006	0,755%	0,58%	0,000%
Total Geral	R\$	275.348.227,23				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: -0,53%



Fundo / Ativo	Rentabilidade no Mês	% Total do Patrimônio	Contribuição para Resultado Mensal
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC			
TITULOS (NTN-B)	-2,08%	11,42%	-0,24%
TITULOS (NTN-C)	0,03%	9,17%	0,00%
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-0,75%	2,77%	-0,02%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	-1,02%	0,47%	0,00%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,89%	3,91%	0,03%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,91%	5,25%	0,05%
Art. 7o, Inciso III - RF Ref.			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	0,74%	3,87%	0,03%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	-0,67%	1,43%	-0,01%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,51%	0,92%	0,00%
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	0,57%	0,81%	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	-0,78%	13,03%	-0,10%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	-3,68%	0,36%	-0,01%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,12%	1,78%	-0,04%
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,34%	0,34%	0,00%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,46%	1,00%	0,00%
Art. 7o, Inciso IV - RF			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	1,12%	3,03%	0,03%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	1,12%	2,66%	0,03%
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,25%	0,90%	0,01%
QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,63%	0,90%	0,01%
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)			
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	1,05%	3,36%	0,04%
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	1,27%	0,33%	0,00%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)			
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	0,40%	0,02%	0,00%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	-0,40%	0,03%	0,00%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	-0,40%	0,01%	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	0,84%	0,97%	0,01%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea B - Crédito Privado			
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,74%	2,54%	0,02%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,49%	1,55%	-0,01%
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.			
BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA INSTITUCIONAL FI EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-1,89%	0,99%	-0,02%
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	-4,15%	0,53%	-0,02%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-1,67%	1,29%	-0,02%

Art. 8o, Inciso III - FIA			
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-0,06%	0,76%	0,00%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FI EM COTAS DE FIA	-4,68%	0,34%	-0,02%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-0,89%	0,70%	-0,01%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	2,51%	1,25%	0,03%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1,59%	0,73%	0,01%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	2,86%	1,31%	0,04%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-5,18%	2,75%	-0,14%
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-0,69%	2,11%	-0,01%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-4,93%	0,68%	-0,03%
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	1,37%	0,58%	0,01%
Art. 8o, Inciso IV - FIM			
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,73%	1,40%	0,01%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	0,56%	0,69%	0,00%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-8,74%	2,22%	-0,19%
Art. 8o, Inciso V - FIP			
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	-0,13%	0,74%	0,00%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	-0,12%	3,44%	0,00%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	-0,23%	0,22%	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	-0,13%	0,94%	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	-4,79%	0,12%	-0,01%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	-1,15%	0,70%	-0,01%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	0,48%	2,07%	0,01%
Em enquadramento - TP CETIP			
TITULOS (TDA)	0,75%	0,58%	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 de porcentagem que o Fundo pode perder em um mês, considerando seus dados seguem uma distribuição normal, quanto maior, pior).

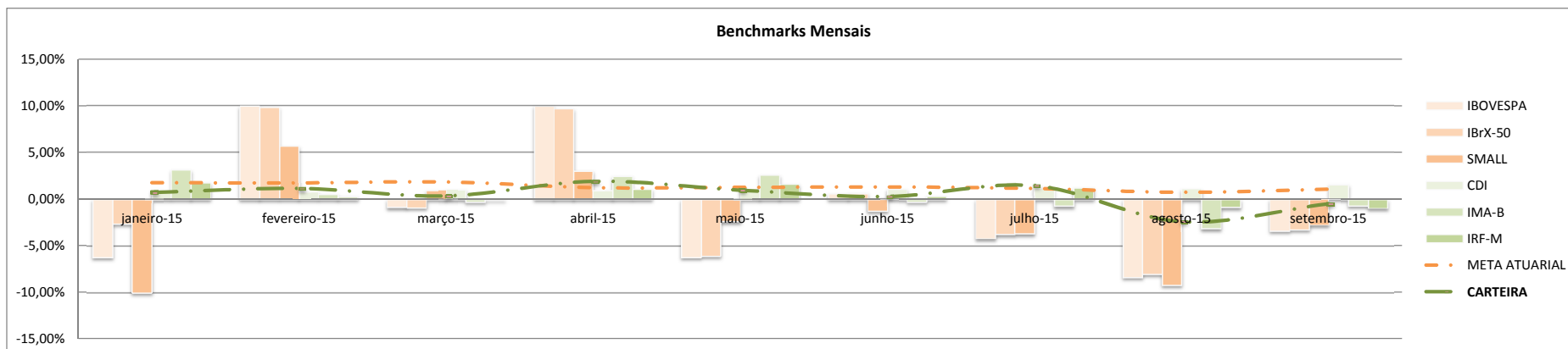
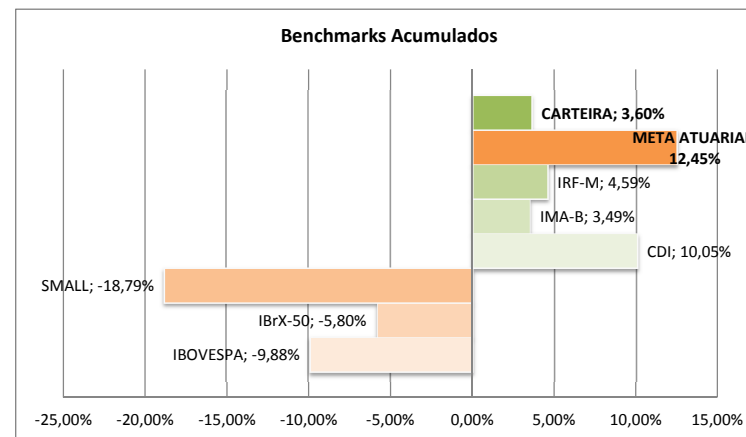
Retorno 12 Meses	Retorno Ano	Retorno Mês	Volatilidade	Sharpe	VaR¹	Retorno Esperado	Minigráfico Ret. 12 meses	Nome do Fundo
7,94%	-1,01%	-0,13%	2,52%	N/D	N/D	0,42%		AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO
-4,68%	-4,32%	-0,13%	2,16%	N/D	N/D	0,16%		ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL
37,99%	38,38%	-0,12%	8,61%	N/D	N/D	1,80%		ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP
-0,30%	-2,45%	-0,06%	4,48%	-3,11	7,84%	0,46%		BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
10,25%	8,11%	0,74%	1,16%	-3,08	2,72%	0,81%		BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI
5,77%	3,43%	-0,67%	2,43%	-1,47	4,83%	0,83%		BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO
10,12%	7,76%	-0,75%	2,43%	0,42	5,01%	1,02%		BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO
6,37%	4,11%	-1,02%	0,92%	-6,76	2,21%	0,70%		BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO
11,44%	8,73%	0,89%	0,16%	-13,04	1,13%	0,87%		BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI
12,86%	9,74%	1,12%	0,12%	-0,95	1,14%	0,95%		BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
11,15%	7,84%	0,51%	0,49%	-1,99	1,71%	0,91%		BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA
11,05%	8,78%	0,57%	0,80%	-11,91	2,16%	0,84%		BRADERCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5
-8,14%	-8,62%	-4,68%	4,03%	-7,22	6,35%	-0,27%		BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FI EM COTAS DE FIA
-7,05%	-4,46%	-1,89%	4,87%	-5,82	7,81%	-0,20%		BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA INSTITUCIONAL FI EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES
-26,88%	-17,65%	-4,15%	4,76%	-11,44	6,09%	-1,75%		DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES
1682,49%	-0,58%	0,40%	342,95%	N/D	N/D	60,56%		FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2
6,97%	-1,33%	-0,40%	28,58%	N/D	N/D	-13,40%		FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3
4,94%	-1,33%	-0,40%	29,10%	N/D	N/D	-17,97%		FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4
-3,00%	-2,16%	-0,23%	28,42%	N/D	N/D	5,04%		FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES
12,03%	9,77%	0,91%	0,83%	0,52	2,34%	0,97%		FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO
16,05%	12,61%	0,73%	0,44%	8,07	1,82%	1,09%		FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO
23,92%	12,00%	0,74%	1,63%	7,63	4,11%	1,43%		FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO
12,68%	9,63%	1,12%	0,12%	-3,34	1,13%	0,93%		FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO
5,84%	3,38%	-0,78%	2,28%	-1,60	4,58%	0,83%		FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP
-3,35%	-5,78%	-0,89%	3,79%	-5,91	6,28%	0,05%		FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS
5,06%	5,78%	0,84%	1,29%	N/D	N/D	0,63%		FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM
-5,62%	-0,62%	-4,79%	2,52%	N/D	N/D	-0,15%		FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND
1,87%	1,24%	-1,15%	1,84%	N/D	N/D	0,87%		FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO AGENCIAS CAIXA - FII
12,23%	8,48%	0,56%	0,45%	N/D	N/D	0,88%		FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO
-2,41%	-3,70%	-3,68%	1,81%	-12,68	2,95%	-0,03%		FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B
-7,93%	-0,16%	2,51%	5,47%	-3,73	9,22%	0,22%		GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
-0,05%	2,66%	1,59%	5,26%	-2,03	9,30%	0,64%		GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
-6,62%	-4,06%	2,86%	4,96%	-4,07	8,37%	0,20%		GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
13,22%	12,83%	1,25%	0,79%	1,35	2,29%	0,99%		INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA
-11,00%	-7,25%	-1,67%	5,25%	-5,97	8,30%	-0,34%		ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO
-5,42%	-7,22%	-0,49%	2,99%	-6,45	5,10%	0,17%		LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO
-1,20%	-8,24%	-8,74%	6,22%	-3,44	10,43%	0,21%		LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO
0,49%	0,62%	-2,12%	2,26%	-5,02	4,22%	0,51%		LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
17,21%	13,12%	1,05%	0,35%	N/D	N/D	1,22%		LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS
8,55%	9,20%	0,34%	1,43%	-1,75	3,21%	0,86%		LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA
14,58%	11,05%	1,27%	0,14%	N/D	N/D	1,07%		OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD
-9,65%	-9,26%	-5,18%	4,13%	-6,83	6,57%	-0,23%		QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
-12,58%	-7,65%	-0,69%	5,04%	-5,76	8,06%	-0,23%		QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES
-11,87%	-7,12%	1,37%	4,73%	-6,85	7,36%	-0,41%		AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES
9,42%	7,76%	0,63%	0,34%	-8,26	1,40%	0,84%		QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO
8,84%	6,83%	0,46%	0,93%	-3,28	2,36%	0,83%		TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5
3,22%	2,27%	0,48%	1,59%	-7,44	3,09%	0,47%		VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO

-16,49%	-14,51%	-4,93%	 4,41%	 -8,48	 6,56%	-0,70%	 WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
16,06%	12,45%	1,03%	 0,33%	N/A	N/A	1,14%	 META ATUARIAL (IPCA + 6%)
13,09%	10,05%	1,57%	 0,18%	N/A	N/A	0,95%	 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								
novembro-15								
dezembro-15								
Acumulado	-9,88%	-5,80%	-18,79%	10,05%	3,49%	4,59%	12,45%	3,60%
Média	-0,95%	-0,49%	-2,17%	1,07%	0,40%	0,50%	1,31%	0,40%
Volatilidade	6,76%	6,33%	5,14%	0,22%	2,00%	1,00%	0,37%	1,28%

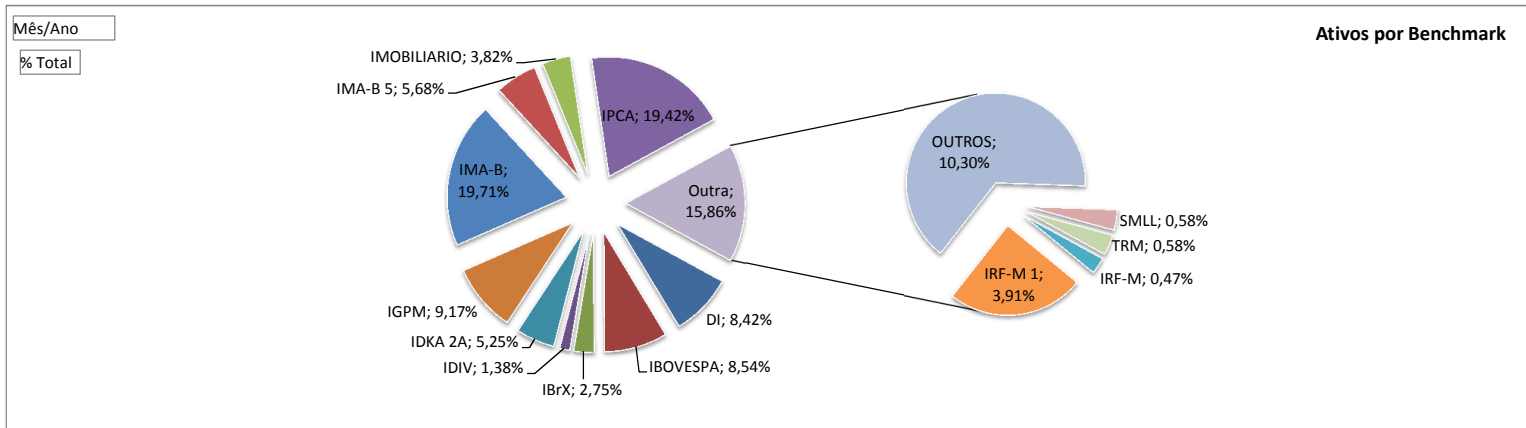


Distribuição da Alocação dos Ativos

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

Mês/Ano setembro-15

BENCHMARK	% Total
DI	8,42%
IBOVESPA	8,54%
IBrX	2,75%
IDIV	1,38%
IDKA 2A	5,25%
IGPM	9,17%
IMA-B	19,71%
IMA-B 5	5,68%
IMOBILIARIO	3,82%
IPCA	19,42%
IRF-M	0,47%
IRF-M 1	3,91%
OUTROS	10,30%
SMLL	0,58%
TRM	0,58%
Total Geral	100,00%

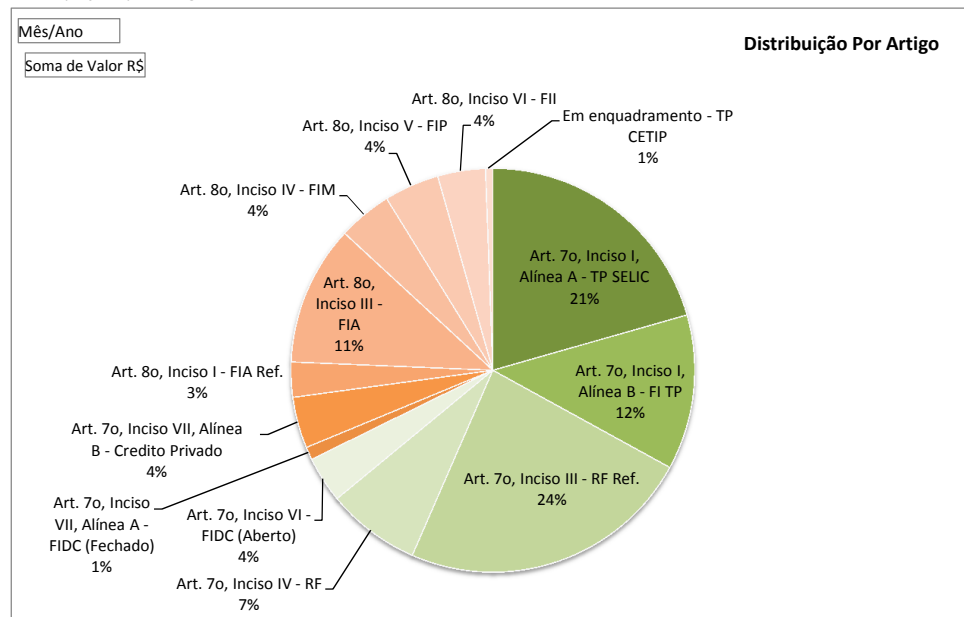


Enquadramento

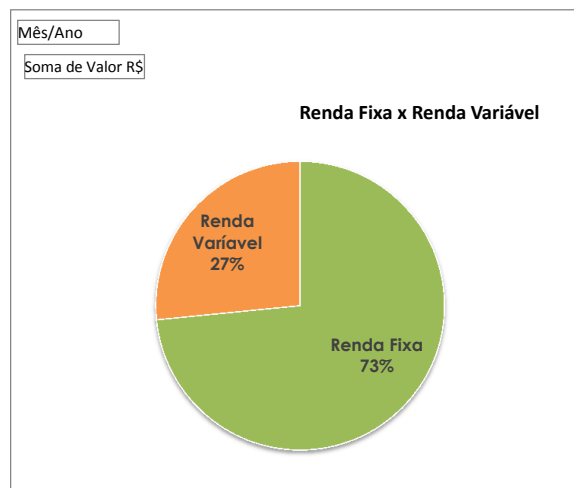
Estes valores mostram se o Hortoprev está enquadrado ou não nos parâmetros da Resolução CMN 3922/2010.

Mês/Ano	set/15				
Artigos Resolução CMN 3922/2010	Soma de Valor R\$	P.A.I	Resultado	Sobra*	
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	20,59%	100,00%	Enquadrado	R\$ 218.664.046,20	
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	12,41%	100,00%	Enquadrado	R\$ 241.176.164,51	
Art. 7o, Inciso III - RF Ref.	23,54%	80,00%	Enquadrado	R\$ 155.469.257,76	
Art. 7o, Inciso IV - RF	7,49%	30,00%	Enquadrado	R\$ 61.971.509,60	
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	3,70%	8,00%	Enquadrado	R\$ 11.846.730,26	
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	1,03%	2,00%	Enquadrado	R\$ 2.676.344,88	
Art. 7o, Inciso VII, Alínea B - Credito Privado	4,10%	5,00%	Enquadrado	R\$ 2.485.601,85	
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	2,80%	30,00%	Enquadrado	R\$ 74.888.114,68	
Art. 8o, Inciso III - FIA	11,22%	15,00%	Enquadrado	R\$ 10.409.550,85	
Art. 8o, Inciso IV - FIM	4,31%	5,00%	Enquadrado	R\$ 1.902.166,26	
Art. 8o, Inciso V - FIP	4,41%	5,00%	Enquadrado	R\$ 1.626.448,56	
Art. 8o, Inciso VI - FII	3,82%	5,00%	Enquadrado	R\$ 3.235.616,71	
Em enquadramento - TP CETIP	0,58%	0,00%	Em enquadramento	-R\$ 1.609.104,53	

*Valor que falta para chegar ao Limite



Mês/Ano	setembro-15			
Rótulos de Linha	Soma de Valor R\$	%	Resultado	
Renda Fixa	R\$ 202.201.187,96	73,43%	Enquadrado	
Renda Variável	R\$ 73.147.039,27	26,57%	Enquadrado	
Total Geral	R\$ 275.348.227,23	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. 6º 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.

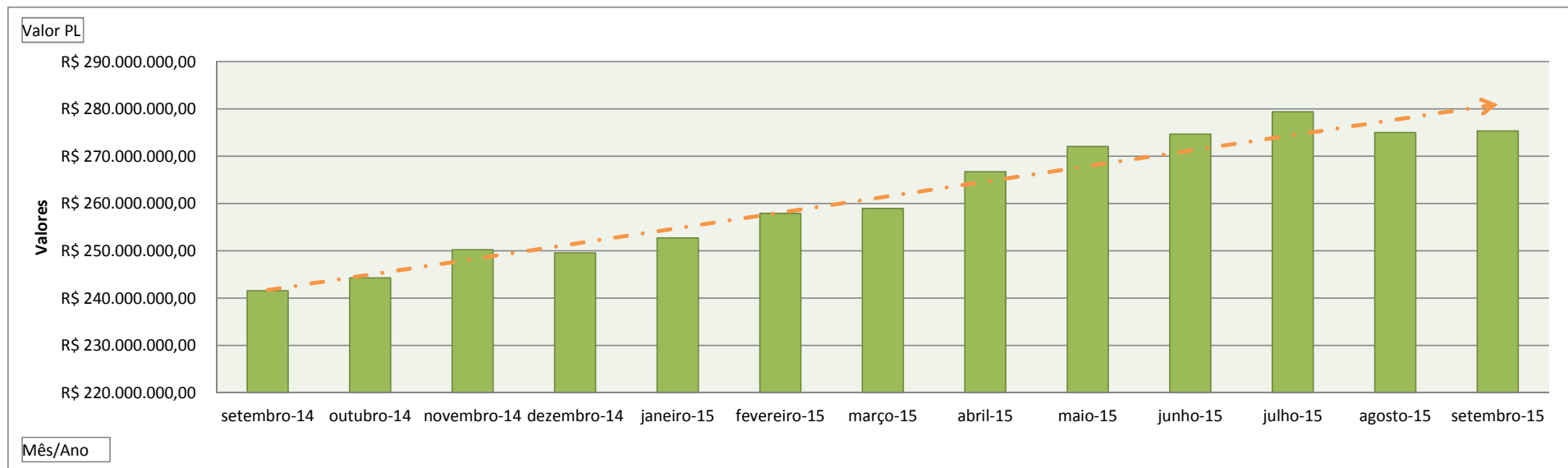
Patrimônio

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

Aplicações e Resgates

Ano	2.015
Mês	9

Tabela Resumida de Aplicações e Resgates		
Fundo	Aplicação	Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 3.445.142,37	R\$ 1.498.013,02
Total Geral	R\$ 3.445.142,37	R\$ 1.498.013,02



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
AQUILLA ASSET	089645450001-20	CRENCIADO	20/04/2015	17/10/2015
FOCO DTVM LTDA.	003295980001-67	CRENCIADO	20/04/2015	17/10/2015
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	003603050001-04	CRENCIADO	05/05/2015	01/11/2015
BRB DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A.	338506860001-69	CRENCIADO	18/05/2015	14/11/2015
QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	045063940001-05	CRENCIADO	29/05/2015	25/11/2015
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
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	623751340001-44	CRENCIADO	14/10/2015	11/04/2016
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	308229360001-69	CRENCIADO	06/10/2015	03/04/2016