

**RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS - OUTUBRO/17**
**Resultado Geral da Carteira de 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, rentabilidades no mês, ano, 12 e 24 meses, além do risco (desvio-padrão) da série de 12 meses. Incluímos as disponibilidades financeiras e detalhes sobre qual a destinação do recurso (administração ou previdência) para maior transparência dos recursos efetivamente em posse do instituto. Os artigos de enquadramento dos fundos são baseados em relatório divulgado pela Secretaria da Previdência Social.

Mês/Ano outubro-17

Destinação do Recurso > Artigo da 3922/2010 > Instrumento de Investimento	Valor	Mês [%]	Ano [%]	12 Meses [%]	24 Meses [%]	Risco [%]
Previdência	R\$ 395.016.732,21					
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - Títulos Públicos	R\$ 72.517.033,26					
TESOURO IGPM+ 770100 (NTN-C)	R\$ 29.784.856,18	0,23%	9,04%	9,19%	24,30%	1,24%
TESOURO IPCA+ 760199 (NTN-B)	R\$ 42.732.177,08	-0,48%	13,88%	15,64%	47,02%	1,88%
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - Fundos Exclusivos de Títulos Públicos	R\$ 181.494.582,50					
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 23.847.892,01	-0,40%	12,49%	14,29%	43,59%	1,81%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 79.071.859,01	0,61%	9,60%	12,01%	28,25%	0,19%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	R\$ 10.573.535,75	1,01%	9,59%	11,51%	15,37%	0,34%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 44.199.686,38	0,74%	11,12%	13,13%	30,89%	0,53%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 23.801.609,35	0,00%	13,35%	15,72%	41,83%	0,82%
Art. 7o, Inciso IV, Alínea A - Fundo de Renda Fixa	R\$ 45.443.525,57					
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 45.443.525,57	0,68%	8,83%	11,22%	26,72%	0,16%
Art. 7o, Inciso III, Alínea A - Fundo de Renda Fixa Referenciado	R\$ 22.761.025,97					
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 13.146.560,97	-0,43%	12,72%	14,57%	43,84%	1,83%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.603.661,40	4,63%	-1,93%	-0,48%	0,98%	4,47%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$ 1.451.810,39	1,13%	12,67%	16,65%	42,54%	1,85%
LME REC IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA	R\$ 4.317.731,12	-0,23%	-11,00%	-25,20%	-20,81%	6,28%
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 1.241.262,09	-0,13%	11,54%	13,48%	27,54%	1,21%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ -	0,62%	6,56%	6,68%	10,49%	0,97%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ -	-1,80%	5,35%	7,19%	6,82%	0,99%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC Cota Senior	R\$ 4.236.835,38					
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	R\$ 34.634,59	-3,61%	-26,36%	-30,84%	-45,80%	5,06%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	R\$ 36.618,69	-3,61%	-26,36%	-30,84%	-45,80%	5,06%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	R\$ 18.416,95	-3,61%	-26,36%	-30,84%	-45,80%	5,06%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$ 2.176.110,93	-0,07%	-3,64%	-3,94%	-6,28%	0,33%
LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	R\$ 1.971.054,22	-0,64%	-45,11%	-43,80%	-79,00%	14,41%
Art. 8o, Inciso II - Fundos de Ações	R\$ 37.457.981,66					
AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 8.636.114,62	0,26%	23,64%	12,77%	48,34%	5,20%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES	R\$ 2.715.444,09	0,19%	39,76%	30,64%	62,59%	6,05%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 2.787.335,04	-2,70%	27,52%	15,18%	35,69%	5,02%
BNP PARIBAS ACTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 4.285.206,03	-0,59%	16,12%	20,07%	44,43%	2,03%
BRZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 1.472.283,64	0,47%	21,78%	12,21%	51,92%	3,94%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR	R\$ 2.700.519,90	-0,70%	19,18%	11,33%	41,98%	3,64%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 2.518.736,52	-0,56%	4,54%	-0,11%	12,39%	3,79%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 4.368.046,29	0,96%	8,59%	1,83%	18,82%	4,47%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 7.974.295,53	-1,12%	19,54%	10,04%	42,60%	3,82%

Art. 8o, Inciso III- Fundos Multimercado	R\$	6.551.428,35					
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	R\$	2.360.008,66	3,90%	8,46%	7,81%	22,24%	1,18%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO C	R\$	4.191.419,69	1,01%	10,21%	-28,63%	-24,74%	10,65%
Art. 8o, Inciso IV, Alinea A - Fundos de Participação	R\$	11.428.753,62					
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÃO	R\$	1.964.998,99	-0,16%	-1,52%	-1,82%	-7,07%	0,01%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	R\$	9.151.953,95	-0,13%	-1,28%	-1,53%	-3,34%	0,01%
FIP BRASIL ÓLEO E GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - MULTISTRATÉGIA	R\$	311.800,68	0,73%	-3,70%	-3,89%	-4,44%	1,02%
Art. 8o, Inciso IV, Alinea B - Fundos Imobiliários	R\$	12.067.556,30					
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$	2.520.509,30	-0,21%	-3,04%	-3,02%	-1,92%	0,67%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	R\$	327.066,96	6,33%	11,48%	11,61%	36,00%	5,51%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO AGENCIAS CAIXA - FII	R\$	2.534.000,00	-0,26%	9,28%	2,49%	50,78%	3,64%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$	6.685.980,04	0,09%	9,24%	11,41%	18,18%	0,79%
Desenquadrado (Em enquadramento Art. 21º, CMN 3922/2010)	R\$	732.323,49					
TÍTULOS DA DÍVIDA AGRÁRIA (TDA)	R\$	732.323,49	0,49%	12,15%	14,53%	25,43%	0,39%
Disponibilidades Financeiras	R\$	325.686,11					
BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 130313-9 / COMPREV	R\$	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 30300-3 / HORTOPREV	R\$	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 61-2 / BENEFÍCIO	R\$	216.323,51	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL / 4088 / 10-8	R\$	100.743,29	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
ITAU / 9183 / 12159-0	R\$	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
SANTANDER / 0178 / 45-002818-8	R\$	8.619,31	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Administração	R\$	3.351.409,15					
Art. 7o, Inciso I, Alinea B - Fundos Exclusivos de Títulos Públicos	R\$	2.642.997,09					
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$	2.642.997,09	0,61%	9,60%	12,01%	28,25%	0,19%
Imóveis	R\$	661.500,00					
LOTE 09 - QUADRA 6A - R. JOSE DE CAMARGO - HORTOLÂNDIA-SP	R\$	189.000,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
LOTE 10 - QUADRA 6A - R. JOSE DE CAMARGO - HORTOLÂNDIA-SP	R\$	189.000,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
LOTE 11 - QUADRA 6A - R. JOSE DE CAMARGO - HORTOLÂNDIA-SP	R\$	283.500,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades Financeiras	R\$	46.912,06					
BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 130-9 / CUSTEIO	R\$	46.912,06	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 5687-1 / PATROCÍNIO	R\$	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 6252-9 / CONSTRUÇÃO	R\$	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total Geral</b>	<b>R\$</b>	<b>398.368.141,36</b>					

### Comparativo com a Meta Atuarial (IPCA + 6% a.a.)

A tabela abaixo e os gráficos abaixo trazem a comparação da carteira do Hortoprev com sua meta atuarial.

Meses	Hortoprev Mês	Atuarial Mês	Hortop. Ano	Atuarial Ano	Hortop. 12M	Atuarial 12M
janeiro-17	1,96%	0,87%	1,96%	0,87%	14,54%	11,68%
fevereiro-17	1,67%	0,82%	3,66%	1,69%	14,92%	11,04%
março-17	0,60%	0,74%	4,29%	2,44%	12,94%	10,85%
abril-17	0,30%	0,63%	4,60%	3,09%	11,82%	10,33%
maio-17	-0,45%	0,80%	4,13%	3,91%	11,82%	9,81%
junho-17	-0,01%	0,26%	4,12%	4,18%	10,05%	9,18%
julho-17	2,29%	0,73%	6,51%	4,93%	9,85%	8,87%
agosto-17	1,39%	0,68%	7,99%	5,65%	10,44%	8,60%
setembro-17	1,47%	0,65%	9,58%	6,33%	10,93%	8,69%
outubro-17	0,28%	0,91%	9,89%	7,30%	9,69%	8,86%

