

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, variação monetária no mês (desconsiderando aplicações e resgates - apenas dos rendimentos) e rentabilidades/metras.

	No Mês	No Ano	12 Meses
Meta Atuarial (IPCA)	0,84%	7,50%	15,38%
Resultado Hortoprev	1,60%	7,39%	8,29%

Mês/Ano Corrente	junho-16					
Artigo de Enquadramento / Ativo Financeiro	Valor Total [R\$]	Rentabilidade Mês [R\$]	Mês [%]	Ano [%]	12 Meses [%]	
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	R\$ 66.700.215,97	R\$ 1.189.803,51				
TITULOS (NTN-B)	R\$ 37.612.421,63	R\$ 595.837,32	1,77%	15,08%	10,16%	
TITULOS (NTN-C)	R\$ 29.087.794,34	R\$ 593.966,19	2,08%	10,89%	14,70%	
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	R\$ 63.546.924,49	R\$ 700.112,04				
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 9.304.785,56	R\$ 173.866,99	1,90%	15,96%	16,24%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 35.705.439,86	R\$ 364.979,29	1,03%	7,34%	14,66%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 18.536.699,07	R\$ 161.265,76	0,88%	9,58%	16,70%	
Art. 7o, Inciso III - RF Ref.	R\$ 57.551.156,33	R\$ 836.235,39				
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 14.716.681,84	R\$ 132.596,95	0,91%	8,75%	16,54%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 30.155.305,50	R\$ 543.735,69	1,84%	15,68%	16,13%	
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.845.155,53	R\$ 23.590,20	0,84%	8,59%	13,13%	
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$ 1.196.328,71	R\$ 20.313,41	1,73%	13,02%	10,83%	
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 4.913.893,93	R\$ 60.262,98	1,24%	0,84%	-8,74%	
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 2.083.166,47	R\$ 29.727,05	1,45%	2,52%	-1,62%	
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 1.029.302,35	R\$ 17.950,99	1,82%	6,45%	12,26%	
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 611.322,00	R\$ 8.058,12	1,34%	4,96%	4,96%	
Art. 7o, Inciso IV - RF	R\$ 41.796.833,61	R\$ 444.592,46				
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMI	R\$ 39.045.862,22	R\$ 411.511,58	1,07%	6,49%	13,92%	
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONG	R\$ 2.750.971,39	R\$ 33.080,88	1,22%	7,70%	13,13%	
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	R\$ 5.886.868,87	-R\$ 164.639,03				
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 4.854.833,93	-R\$ 178.243,93	-3,54%	-46,62%	-43,07%	
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	R\$ 1.032.034,94	R\$ 13.604,90	1,31%	7,80%	16,27%	
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	R\$ 2.692.982,02	-R\$ 5.004,71				
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	R\$ 48.660,79	-R\$ 945,18	-1,91%	-16,15%	-27,04%	
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	R\$ 51.447,91	-R\$ 999,31	-1,91%	-16,15%	-27,62%	
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	R\$ 25.875,15	-R\$ 502,62	-1,91%	-16,15%	-27,62%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$ 2.566.998,17	-R\$ 2.557,60	0,00%	-1,38%	2,71%	

Art. 7o, Inciso VII, Alínea B - Credito Privado	R\$ 7.831.156,00	R\$ 94.712,00				
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	R\$ 7.831.156,00	R\$ 94.712,00	1,22%	7,97%	15,09%	
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	R\$ 4.041.573,48	R\$ 211.614,45				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMEN	R\$ 4.041.573,48	R\$ 211.614,45	5,53%	8,36%	-2,15%	
Art. 8o, Inciso III - FIA	R\$ 31.644.664,46	R\$ 1.312.921,94				
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 2.148.753,63	R\$ 103.623,17	5,07%	9,94%	-4,40%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDEN	R\$ 2.179.211,62	R\$ 53.121,38	2,50%	5,77%	3,78%	
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 5.056.909,36	R\$ 222.044,52	4,46%	-16,95%	-15,20%	
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 3.733.368,28	R\$ 146.599,59	3,91%	-18,39%	-16,44%	
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 3.371.056,17	R\$ 197.229,28	6,21%	-16,19%	-14,15%	
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 6.357.552,16	R\$ 259.278,82	4,25%	7,98%	-0,56%	
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTI	R\$ 1.082.265,22	R\$ 29.196,82	2,77%	9,79%	4,71%	
AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 5.933.929,80	R\$ 221.712,43	3,88%	-0,88%	-9,09%	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES	R\$ 1.781.618,22	R\$ 80.115,93	4,71%	0,83%	5,17%	
Art. 8o, Inciso IV - FIM	R\$ 12.103.237,28	R\$ 146.823,86				
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 4.339.690,95	R\$ 55.168,60	1,29%	8,57%	15,92%	
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	R\$ 2.092.656,82	R\$ 22.306,43	1,08%	5,79%	11,99%	
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PF	R\$ 5.670.889,51	R\$ 69.348,83	1,24%	8,11%	-27,33%	
Art. 8o, Inciso V - FIP	R\$ 11.675.639,62	-R\$ 16.785,46				
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICC	R\$ 2.013.839,76	-R\$ 3.105,51	-0,15%	-0,88%	-4,94%	
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	R\$ 9.343.065,25	-R\$ 13.252,95	-0,14%	-0,79%	37,11%	
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	R\$ 318.734,61	-R\$ 427,00	-0,13%	-0,39%	-48,23%	
Art. 8o, Inciso VI - FII	R\$ 11.133.988,99	R\$ 166.595,50				
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$ 2.607.062,77	-R\$ 961,62	-0,04%	1,46%	0,82%	
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	R\$ 287.757,90	R\$ 11.361,00	5,13%	18,84%	9,11%	
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	R\$ 2.076.000,00	R\$ 20.020,00	1,80%	11,47%	14,73%	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$ 6.163.168,32	R\$ 136.176,12	2,26%	8,77%	8,30%	
Disponibilidades Financeiras	R\$ 162.742,82	R\$ -				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS (CONTAS CORRENTES HORTOPREV)	R\$ 162.742,82	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
Em enquadramento	R\$ 5.303.633,98	R\$ 36.653,43				
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 3.922.840,00	R\$ 20.033,38	0,51%	2,92%	-9,93%	
TITULOS (TDA)	R\$ 1.380.793,98	R\$ 16.620,05	1,22%	7,47%	5,16%	
Imóveis	R\$ 661.500,00	R\$ -				
IMÓVEIS (TERRENOS)	R\$ 661.500,00	R\$ -	0,00%	0,00%	0,00%	
Total Geral	R\$ 322.733.117,92	R\$ 4.953.635,38				

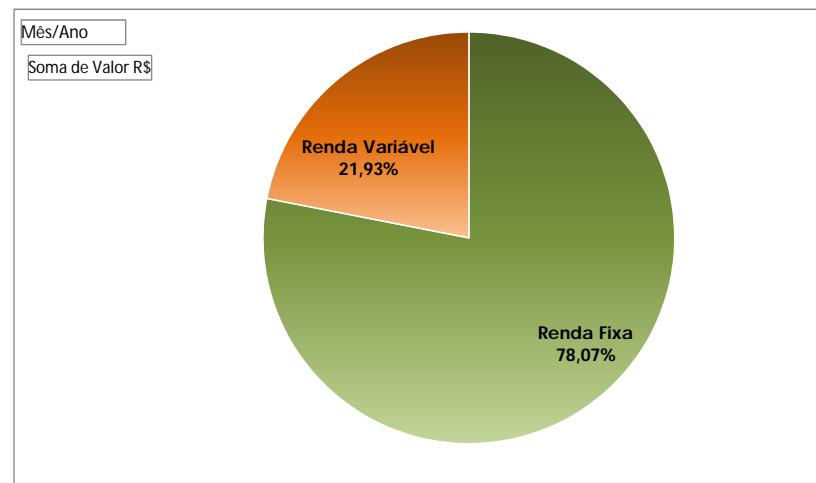
Enquadramento

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

Mês/Ano	junho-16	
Fundos	Teto 25%	Teto 20%
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	1,44%	0,81%
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLC	5,42%	0,63%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	2,72%	2,90%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	3,01%	0,67%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	0,84%	4,57%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	3,12%	9,37%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,20%	2,89%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,47%	11,09%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTC	0,67%	12,13%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	4,17%	0,88%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMEN	2,88%	0,34%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	0,64%	0,02%
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%	0,10%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,48%	5,76%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4,52%	1,35%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7,24%	2,43%
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%	0,80%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	0,01%	0,09%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	0,48%	0,64%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	2,95%	0,65%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1,93%	0,37%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	3,90%	1,57%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1,57%	1,16%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	5,27%	1,05%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	0,86%	1,26%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	12,78%	1,22%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVA	14,12%	1,76%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,79%	1,53%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	2,53%	1,51%
OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD	0,25%	0,32%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	20,36%	1,97%
TÍTULOS (NTN-B)	0,00%	11,68%
TÍTULOS (NTN-C)	0,00%	9,04%
TÍTULOS (TDA)	0,00%	0,43%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,52%	0,65%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	19,11%	1,91%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PI	1,49%	0,85%
AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	4,88%	1,84%
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	2,06%	0,32%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,51%	0,19%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES	1,68%	0,55%

Situação: Enquadrado Enquadrado

Mês/Ano	junho-16		
Tipo	Soma de Valor R\$	%	Resultado
Renda Fixa	R\$ 251.309.771,27	78,07%	Enquadrado
Renda Variável	R\$ 70.599.103,83	21,93%	Enquadrado
Total Geral	R\$ 321.908.875,10	100,00%	



Mês/Ano	jun/16		
Artigos Resolução CMN 3922/2010	% Total	Límite	Situação
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	20,72%	100,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	19,74%	100,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso III - RF Ref.	17,88%	80,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso IV - RF	12,98%	30,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	1,83%	8,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	0,84%	2,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VII, Alínea B - Credito Privado	2,43%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	1,26%	30,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso III - FIA	9,83%	15,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso IV - FIM	3,76%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso V - FIP	3,63%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso VI - FII	3,46%	5,00%	Enquadrado
Em enquadramento	1,65%	0,00%	Em enquadramento

Limite 15% PL (Soma Art. 6º VI e VII) Art. 7º § 5º Enquadrado

Provisão para Boletins de Subscrição:				
Fundo	Total Boletim	Data	Não utilizado	
FIP BRASIL ÓLEO E GÁS	R\$ 2.000.000,00	jun-12	R\$	1.324.000,00

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	Situação Processo
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S/A	276526840001-62	CRENCIADO	24/02/2016	22/08/2016	279/2015	Concluído
ITAÚ UNIBANCO S.A.	607011900001-04	CRENCIADO	21/03/2016	17/09/2016	137/2016	Concluído
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA	074372410001-41	CRENCIADO	29/03/2016	25/09/2016	146/2016	Concluído
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	072508640001-00	CRENCIADO	30/03/2016	26/09/2016	148/2016	Concluído
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	308229360001-69	CRENCIADO	15/04/2016	12/10/2016	191/2016	Concluído