

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].

	Set/16	No Ano	12 Meses
Meta Atuarial (IPCA)	0,57%	10,22%	14,99%
Resultado Hortoprev	1,02%	12,12%	14,89%

Mês/Ano Corrente	setembro-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\$ 68.680.920,09		R\$ 781.156,65			
TITULOS (NTN-B)	R\$ 38.873.619,75		R\$ 540.218,49	1,41%	21,41%	26,40%
TITULOS (NTN-C)	R\$ 29.807.300,34		R\$ 240.938,16	0,81%	13,63%	18,08%
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	R\$ 80.045.904,21		R\$ 1.057.669,02			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 9.773.025,42		R\$ 150.476,27	1,56%	21,80%	27,99%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 42.079.775,00		R\$ 484.064,61	1,16%	10,97%	14,91%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 19.222.114,85		R\$ 252.503,78	1,33%	12,42%	18,28%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 8.970.988,94		R\$ 170.624,36	1,94%	19,20%	22,01%
Art. 7o, Inciso III, Alínea A - RF Ref.	R\$ 60.058.487,82		R\$ 852.101,23			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 15.265.026,75		R\$ 209.668,96	1,39%	12,80%	18,55%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 31.714.596,20		R\$ 512.663,90	1,64%	21,66%	27,79%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.920.391,27		R\$ 20.216,20	0,70%	10,72%	14,88%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$ 1.239.131,03		R\$ 5.655,90	0,46%	17,07%	24,94%
LEMÉ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 5.080.824,23		R\$ 55.284,37	1,10%	4,49%	3,76%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 2.166.014,85		R\$ 26.405,93	1,23%	6,60%	1,38%
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 1.081.289,42		R\$ 16.008,28	1,50%	11,83%	16,09%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 591.214,07		R\$ 6.197,69	1,06%	1,50%	1,50%
Art. 7o, Inciso IV, Alínea A - RF	R\$ 43.276.370,49		R\$ 472.893,26			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMI	R\$ 40.428.042,49		R\$ 445.654,92	1,11%	10,26%	14,00%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONG	R\$ 2.848.328,00		R\$ 27.238,34	0,97%	11,44%	15,08%
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	R\$ 5.327.040,27		-R\$ 410.201,06			
LEMÉ MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 4.253.734,85		-R\$ 423.712,36	-9,06%	-54,64%	-54,06%
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	R\$ 1.073.305,42		R\$ 13.511,30	1,27%	12,08%	16,42%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	R\$ 2.503.099,52		-R\$ 63.853,94			
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	R\$ 51.324,39		R\$ 8.947,92	21,12%	-11,56%	-21,44%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	R\$ 54.621,96		R\$ 776,73	1,44%	-10,98%	-20,92%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	R\$ 27.291,51		R\$ 217,91	0,80%	-11,56%	-21,44%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$ 2.369.861,66		-R\$ 73.796,50	-0,43%	-4,12%	-2,51%
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	R\$ 4.430.413,41		-R\$ 9.652,40			
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMEN	R\$ 4.430.413,41		-R\$ 9.652,40	-0,22%	28,10%	25,10%

Art. 8o, Inciso III - FIA	R\$	35.247.289,32	R\$	172.559,45			
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	2.415.631,40	R\$	50.553,83	2,14%	23,60%	15,38%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDEN	R\$	2.311.041,19	R\$	384,66	0,02%	17,19%	24,78%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	5.695.673,94	R\$	57.464,11	1,02%	-1,12%	-0,01%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	4.174.240,34	R\$	38.488,13	0,93%	-2,15%	-2,96%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.886.588,49	R\$	33.920,37	0,88%	2,96%	5,63%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	6.826.872,89	R\$	27.451,78	0,40%	21,65%	23,67%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTI	R\$	1.187.148,03	R\$	5.585,55	0,47%	23,54%	26,78%
AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$	6.852.389,45	-R\$	13.783,93	-0,20%	23,59%	18,21%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES	R\$	1.897.703,59	-R\$	27.505,05	-1,43%	17,29%	18,00%
Art. 8o, Inciso IV - FIM	R\$	12.416.042,10	R\$	113.612,89			
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$	4.464.299,70	R\$	41.402,30	0,94%	11,41%	15,56%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	R\$	2.118.103,08	R\$	19.041,90	0,91%	6,39%	11,34%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PF	R\$	5.833.639,32	R\$	53.168,69	0,92%	10,97%	-4,36%
Art. 8o, Inciso V - FIP	R\$	11.632.548,43	-R\$	15.516,66			
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICC	R\$	2.004.209,10	-R\$	3.140,01	-0,16%	-4,91%	-5,41%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	R\$	9.305.886,15	-R\$	12.050,50	-0,13%	-1,18%	-1,83%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	R\$	322.453,18	-R\$	326,15	-0,10%	-0,31%	-47,54%
Art. 8o, Inciso VI - FII	R\$	11.554.629,94	R\$	257.101,00			
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$	2.604.575,15	-R\$	1.409,33	-0,05%	1,64%	1,12%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	R\$	316.582,38	R\$	9.023,88	3,79%	34,38%	28,13%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	R\$	2.578.000,00	R\$	196.000,00	9,00%	41,54%	45,12%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$	6.055.472,41	R\$	53.486,45	0,89%	6,87%	7,09%
Disponibilidades Financeiras	R\$	150.181,74					
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\$	17.870,81	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\$	31.368,89	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\$	89.934,77	R\$	-	0,00%	0,00%	0,00%
SANTANDER / 0178 / 45-002818-8	R\$	10.725,68	R\$	-	0,00%	0,00%	0,00%
Em enquadramento	R\$	5.432.756,52	R\$	80.028,81			
TITULOS (TDA)	R\$	1.415.254,59	R\$	18.259,66	1,31%	11,69%	8,49%
LME CREDITO PRIVADO REC FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$	4.017.501,93	R\$	61.769,15	1,56%	5,40%	5,27%
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\$	341.417.183,86	R\$	3.287.898,25			

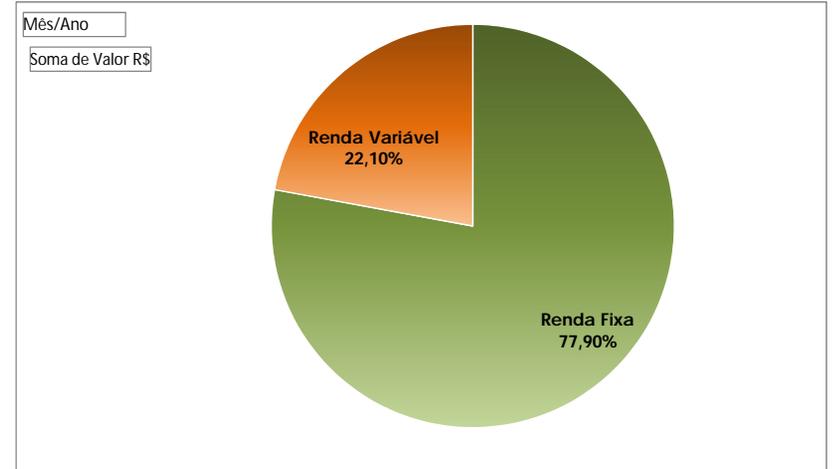
Enquadramento

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

Mês/Ano	setembro-16	
Fundos	% P.L. Fundo	% Carteira
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	1,41%	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%	2,73%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	3,05%	0,71%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	0,68%	4,48%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	2,71%	9,31%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,18%	2,87%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,52%	12,35%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTC	0,76%	11,87%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	4,17%	0,86%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMEN	2,91%	0,35%
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%	0,09%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,42%	5,64%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4,52%	1,31%
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%	0,70%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	0,01%	0,09%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	0,59%	0,76%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	1,43%	0,62%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1,40%	0,36%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	3,81%	1,67%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1,50%	1,23%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	5,37%	1,14%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	0,95%	1,30%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVA	14,12%	1,71%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,79%	1,49%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	2,53%	1,25%
OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD	0,26%	0,32%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	18,40%	2,00%
TITULOS (NTN-B)	0,00%	11,41%
TITULOS (NTN-C)	0,00%	8,75%
TITULOS (TDA)	0,00%	0,42%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,47%	0,64%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	18,52%	1,78%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PI	1,24%	0,84%
AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	5,76%	2,01%
TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,46%	0,32%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,52%	0,17%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES	1,41%	0,56%
LME CREDITO PRIVADO REC FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	12,78%	1,18%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,78%	2,63%

Situação: **Enquadrado** **Enquadrado**

Mês/Ano	setembro-16		
Tipo	Soma de Valor R\$	%	Enquadramento
Renda Fixa	R\$ 265.324.578,92	77,90%	Enquadrado
Renda Variável	R\$ 75.280.923,20	22,10%	Enquadrado
Total Geral	R\$ 340.605.502,12	100,00%	Enquadrado



Mês/Ano	setembro-16		
Artigos Resolução CMN 3922/2010	% Total	P.A.I.	Situação
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	20,16%	100,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	23,50%	100,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso III, Alínea A - RF Ref.	17,63%	80,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso IV, Alínea A - RF	12,71%	30,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	1,56%	8,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	0,73%	2,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	1,30%	30,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso III - FIA	10,35%	15,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso IV - FIM	3,65%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso V - FIP	3,42%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso VI - FII	3,39%	5,00%	Enquadrado
Em enquadramento	1,60%	0,00%	Em Enquadram.

Limite 15% PL
(Soma Art. ° VI e VII) **Art. 7° § 5°** **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\$ 1.320.000,00

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