

Resultado Mensal dos Investimentos - Por Artigo

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, rentabilidade no mês, proporcionalidade do total do ativo no total do patrimônio do Instituto e proporcionalidade das cotas do Instituto nos Fundos.

Mês/Ano	janeiro-16				
Artigo de Enquadramento / Ativo Financeiro	Valor Total	Variação Mês (R\$)	Rent. Mes (%)	% P.L. Hortoprev	% P.L. Fundo
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	R\$ 60.201.824,42	R\$ 1.234.225,81		20,40%	
TITULOS (NTN-B)	R\$ 33.210.738,75	R\$ 475.278,85	1,610%	11,26%	0,00%
TITULOS (NTN-C)	R\$ 26.991.085,67	R\$ 758.946,96	2,893%	9,15%	0,00%
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	R\$ 46.365.238,95	R\$ 872.130,00		15,71%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 8.170.571,67	R\$ 146.696,20	1,828%	2,77%	0,20%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 22.554.492,89	R\$ 289.109,06	1,624%	7,64%	0,30%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 15.640.174,39	R\$ 436.324,74	2,870%	5,30%	0,60%
Art. 7o, Inciso III - RF Ref.	R\$ 56.144.237,81	R\$ 1.098.373,65		19,03%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 11.520.681,15	R\$ 329.803,33	2,947%	3,90%	0,96%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 4.219.994,82	R\$ 77.676,01	1,875%	1,43%	0,49%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.685.307,91	R\$ 47.718,54	1,809%	0,91%	4,17%
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	R\$ 2.413.527,59	R\$ 69.665,47	2,972%	0,82%	1,41%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 25.635.124,95	R\$ 415.478,41	1,647%	8,69%	1,12%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$ 1.071.650,63	R\$ 13.184,04	1,246%	0,36%	1,93%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 4.913.330,51	R\$ 50.659,08	1,042%	1,67%	4,79%
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 986.728,88	R\$ 19.793,43	2,047%	0,33%	2,23%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 2.697.891,37	R\$ 74.395,34	2,836%	0,91%	0,46%
Art. 7o, Inciso IV - RF	R\$ 39.648.349,02	R\$ 430.171,89		13,44%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 8.728.310,09	R\$ 90.995,36	1,054%	2,96%	0,14%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 25.729.320,98	R\$ 266.724,00	1,048%	8,72%	0,60%
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.594.610,40	R\$ 32.201,32	1,257%	0,88%	6,05%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 2.596.107,55	R\$ 40.251,21	1,575%	0,88%	2,01%
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	R\$ 10.326.664,14	-R\$ 8.021,33		3,50%	
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 9.357.379,62	-R\$ 19.648,42	-0,210%	3,17%	2,53%
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	R\$ 969.284,52	R\$ 11.627,09	1,214%	0,33%	0,26%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	R\$ 2.839.989,07	R\$ 18.488,64		0,96%	
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	R\$ 55.932,00	-R\$ 2.138,28	-3,620%	0,02%	0,64%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	R\$ 59.135,57	-R\$ 2.260,76	-3,620%	0,02%	0,68%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	R\$ 29.741,58	-R\$ 1.137,02	-3,620%	0,01%	0,34%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$ 2.695.179,92	R\$ 24.024,70	0,980%	0,91%	2,17%
Art. 7o, Inciso VII, Alínea B - Credito Privado	R\$ 11.218.028,97	R\$ 135.133,73		3,80%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	R\$ 7.371.960,00	R\$ 100.772,00	1,386%	2,50%	7,24%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 3.846.068,97	R\$ 34.361,73	0,901%	1,30%	12,78%
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	R\$ 4.665.559,09	-R\$ 163.725,04		1,58%	

DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	R\$	1.328.476,71	-R\$	42.201,54	-3,079%	0,45%	18,55%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	3.337.082,38	-R\$	121.523,50	-3,514%	1,13%	0,81%
Art. 8o, Inciso III - FIA	R\$	27.767.404,47	-R\$	1.113.522,04			9,41%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	1.861.408,67	-R\$	93.020,21	-4,759%	0,63%	2,72%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	R\$	1.985.269,05	-R\$	27.672,27	-1,350%	0,67%	0,66%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.207.747,64	-R\$	280.205,09	-8,034%	1,09%	2,54%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	1.882.486,94	-R\$	116.234,42	-5,815%	0,64%	0,73%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.445.467,84	-R\$	260.056,69	-7,018%	1,17%	5,02%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	5.603.282,67	-R\$	100.084,41	-0,154%	1,90%	19,83%
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$	5.364.437,27	-R\$	180.131,25	-3,249%	1,82%	4,95%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	1.856.803,13	-R\$	51.527,86	-2,700%	0,63%	5,40%
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	R\$	1.611.059,39	R\$	6.875,28	-0,425%	0,55%	1,82%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	949.441,87	-R\$	11.465,12	-1,193%	0,32%	2,87%
Art. 8o, Inciso IV - FIM	R\$	11.400.822,30	R\$	145.810,40			3,86%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$	4.062.771,65	R\$	55.723,20	1,391%	1,38%	4,52%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	R\$	2.004.762,54	R\$	13.816,02	0,694%	0,68%	3,31%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$	5.333.288,11	R\$	76.271,18	1,451%	1,81%	14,12%
Art. 8o, Inciso V - FIP	R\$	11.754.831,65	-R\$	15.277,99			3,98%
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	R\$	2.028.852,94	-R\$	2.944,64	-0,145%	0,69%	5,42%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	R\$	9.405.022,95	-R\$	12.109,25	-0,129%	3,19%	2,74%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	R\$	320.955,76	-R\$	224,10	-0,070%	0,11%	0,40%
Art. 8o, Inciso VI - FII	R\$	10.563.652,64	R\$	25.116,53			3,58%
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$	2.558.657,04	-R\$	3.909,59	-0,153%	0,87%	1,44%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	R\$	262.146,96	-R\$	41.191,74	-12,569%	0,09%	0,01%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	R\$	1.898.000,00	-R\$	62.000,00	-2,316%	0,64%	0,44%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$	5.844.848,64	R\$	132.217,86	2,314%	1,98%	19,11%
Em enquadramento - TP CETIP	R\$	1.347.064,65	R\$	24.414,68			0,46%
TITULOS (TDA)	R\$	1.347.064,65	R\$	24.414,68	1,846%	0,46%	0,00%
Disponibilidades Financeiras	R\$	137.653,32	-R\$	1.190.823,39			0,05%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS (CONTAS CORRENTES HORTOPREV)	R\$	137.653,32	-R\$	1.190.823,39	0,000%	0,05%	0,00%
Art. 9o - Imóveis	R\$	661.500,00	R\$	-			0,22%
IMÓVEIS (TERRENOS)	R\$	661.500,00	R\$	-	0,000%	0,22%	0,00%
Total Geral	R\$	295.042.820,50	R\$	1.492.495,54			100,00%

Resultado Mensal dos Investimentos - Por Instituição Financeira

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, rentabilidade no mês, proporcionalidade do total do ativo no total do patrimônio do Instituto e proporcionalidade das cotas do Instituto nos Fundos.

Mês/Ano	janeiro-16					
Instituição Financeira / Ativo Financeiro	Valor Total	Variação do Mês (R\$)	Rent. Mes (%)	% P.L. Hortoprev	% P.L. Fundo	
AQUILLA ASSET	R\$ 2.558.657,04	-R\$ 3.909,59		0,87%		
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$ 2.558.657,04	-R\$ 3.909,59	-0,153%	0,87%	1,439%	
ÁTICO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 11.433.875,89	-R\$ 15.053,89		3,88%		
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	R\$ 2.028.852,94	-R\$ 2.944,64	-0,145%	0,69%	5,419%	
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	R\$ 9.405.022,95	-R\$ 12.109,25	-0,129%	3,19%	2,738%	
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	R\$ 57.055.459,29	R\$ 841.259,75		19,34%		
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 1.861.408,67	-R\$ 93.020,21	-4,759%	0,63%	2,723%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 11.520.681,15	R\$ 329.803,33	2,947%	3,90%	0,958%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 4.219.994,82	R\$ 77.676,01	1,875%	1,43%	0,493%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 8.170.571,67	R\$ 146.696,20	1,828%	2,77%	0,200%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 22.554.492,89	R\$ 289.109,06	1,624%	7,64%	0,301%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 8.728.310,09	R\$ 90.995,36	1,054%	2,96%	0,136%	
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS	R\$ 2.413.527,59	R\$ 69.665,47		0,82%		
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	R\$ 2.413.527,59	R\$ 69.665,47	2,972%	0,82%	1,406%	
BRASIL PLURAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 144.809,15	-R\$ 5.536,06		0,05%		
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	R\$ 55.932,00	-R\$ 2.138,28	-3,620%	0,02%	0,639%	
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	R\$ 59.135,57	-R\$ 2.260,76	-3,620%	0,02%	0,675%	
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	R\$ 29.741,58	-R\$ 1.137,02	-3,620%	0,01%	0,340%	
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA	R\$ 2.697.891,37	R\$ 74.395,34		0,91%		
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 2.697.891,37	R\$ 74.395,34	2,836%	0,91%	0,459%	
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 949.441,87	-R\$ 11.465,12		0,32%		
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 949.441,87	-R\$ 11.465,12	-1,193%	0,32%	2,869%	
BTG PACTUAL WM GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 262.146,96	-R\$ 41.191,74		0,09%		
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	R\$ 262.146,96	-R\$ 41.191,74	-12,569%	0,09%	0,009%	
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 139.988.241,04	R\$ 2.533.662,84		47,45%		
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 15.640.174,39	R\$ 436.324,74	2,870%	5,30%	0,601%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 4.062.771,65	R\$ 55.723,20	1,391%	1,38%	4,525%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	R\$ 7.371.960,00	R\$ 100.772,00	1,386%	2,50%	7,237%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 25.729.320,98	R\$ 266.724,00	1,048%	8,72%	0,602%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 25.635.124,95	R\$ 415.478,41	1,647%	8,69%	1,122%	
TITULOS (NTN-B)	R\$ 33.210.738,75	R\$ 475.278,85	1,610%	11,26%	0,000%	
TITULOS (NTN-C)	R\$ 26.991.085,67	R\$ 758.946,96	2,893%	9,15%	0,000%	
TITULOS (TDA)	R\$ 1.347.064,65	R\$ 24.414,68	1,846%	0,46%	0,000%	

























DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADMINISTRACAO DE RECURSOS LTDA	R\$	1.328.476,71	-R\$	42.201,54			0,45%
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	R\$	1.328.476,71	-R\$	42.201,54	-3,079%	0,45%	18,546%
FMD GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	R\$	2.004.762,54	R\$	13.816,02			0,68%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	R\$	2.004.762,54	R\$	13.816,02	0,694%	0,68%	3,312%
G F GESTÃO DE RECURSOS S/A	R\$	8.535.702,42	-R\$	656.496,20			2,89%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.207.747,64	-R\$	280.205,09	-8,034%	1,09%	2,543%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	1.882.486,94	-R\$	116.234,42	-5,815%	0,64%	0,735%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.445.467,84	-R\$	260.056,69	-7,018%	1,17%	5,023%
GENUS CAPITAL GROUP GESTAO DE RECURSOS LTDA	R\$	1.071.650,63	R\$	13.184,04			0,36%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$	1.071.650,63	R\$	13.184,04	1,246%	0,36%	1,927%
INFINITY ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	R\$	2.594.610,40	R\$	32.201,32			0,88%
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$	2.594.610,40	R\$	32.201,32	1,257%	0,88%	6,055%
INTERATIVA INVESTIMENTOS LTDA.	R\$	2.685.307,91	R\$	47.718,54			0,91%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$	2.685.307,91	R\$	47.718,54	1,809%	0,91%	4,171%
ITAU DTVM S.A.	R\$	3.337.082,38	-R\$	121.523,50			1,13%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	3.337.082,38	-R\$	121.523,50	-3,514%	1,13%	0,811%
LEME INVESTIMENTOS LTDA	R\$	23.450.067,21	R\$	141.643,57			7,95%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	R\$	3.846.068,97	R\$	34.361,73	0,901%	1,30%	12,782%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$	5.333.288,11	R\$	76.271,18	1,451%	1,81%	14,120%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$	4.913.330,51	R\$	50.659,08	1,042%	1,67%	4,793%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	R\$	9.357.379,62	-R\$	19.648,42	-0,210%	3,17%	2,526%
OLIVEIRA TRUST DTVM S.A.	R\$	969.284,52	R\$	11.627,09			0,33%
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	R\$	969.284,52	R\$	11.627,09	1,214%	0,33%	0,261%
PETRA PERSONAL TRADER CTVM S/A	R\$	2.695.179,92	R\$	24.024,70			0,91%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$	2.695.179,92	R\$	24.024,70	0,980%	0,91%	2,169%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$	5.603.282,67	-R\$	100.084,41			1,90%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	5.603.282,67	-R\$	100.084,41	-0,154%	1,90%	19,828%
QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	R\$	9.571.604,21	-R\$	133.004,76			3,24%
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$	5.364.437,27	-R\$	180.131,25	-3,249%	1,82%	4,950%
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	R\$	1.611.059,39	R\$	6.875,28	-0,425%	0,55%	1,817%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$	2.596.107,55	R\$	40.251,21	1,575%	0,88%	2,011%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA	R\$	1.898.000,00	-R\$	62.000,00			0,64%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	R\$	1.898.000,00	-R\$	62.000,00	-2,316%	0,64%	0,439%
VALORA GESTÃO DE INVESTIMENTOS LTDA.	R\$	320.955,76	-R\$	224,10			0,11%

FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	R\$	320.955,76	-R\$	224,10	-0,070%	0,11%	0,400%
VECTOR ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA / QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$	5.844.848,64	R\$	132.217,86		1,98%	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$	5.844.848,64	R\$	132.217,86	2,314%	1,98%	19,111%
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$	1.985.269,05	-R\$	27.672,27		0,67%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	R\$	1.985.269,05	-R\$	27.672,27	-1,350%	0,67%	0,665%
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA	R\$	1.856.803,13	-R\$	51.527,86		0,63%	
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	1.856.803,13	-R\$	51.527,86	-2,700%	0,63%	5,397%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	R\$	137.653,32	-R\$	1.190.823,39		0,05%	
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS (CONTAS CORRENTES HORTOPREV)	R\$	137.653,32	-R\$	1.190.823,39	0,000%	0,05%	0,000%
HORTOPREV	R\$	661.500,00	R\$	-		0,22%	
IMÓVEIS (TERRENOS)	R\$	661.500,00	R\$	-	0,000%	0,22%	0,000%
TMJ CAPITAL GESTAO DE RECURSOS LTDA	R\$	986.728,88	R\$	19.793,43	2,047%	0,33%	2,226%
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$	986.728,88	R\$	19.793,43	2,047%	0,33%	2,226%
Total Geral	R\$	295.042.820,50	R\$	1.492.495,54		100,00%	

Resultado Mensal dos Investimentos - Desempenho Total

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:		1,04%		
Mês/Ano	janeiro-16			
Fundo / Ativo	Rentabilidade no Mês	% Total do Patrimônio	Contribuição para Resultado Mensal	
DI				
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	1,05%	2,96%	0,03%	
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,81%	0,91%	0,02%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	1,05%	8,72%	0,09%	
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,26%	0,88%	0,01%	
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	1,57%	0,88%	0,01%	
IBOVESPA				
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	-3,08%	0,45%	-0,01%	
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-8,03%	1,09%	-0,09%	
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-5,82%	0,64%	-0,04%	
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-7,02%	1,17%	-0,08%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-3,51%	1,13%	-0,04%	
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-3,25%	1,82%	-0,06%	
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-1,19%	0,32%	0,00%	
IBrX				
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-0,15%	1,90%	0,00%	
IDIV				
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	-1,35%	0,67%	-0,01%	
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-2,70%	0,63%	-0,02%	
IDKA 2A				
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	2,87%	5,30%	0,15%	
IGPM				
TITULOS (NTN-C)	2,89%	9,15%	0,26%	
IMA-B				
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	1,88%	1,43%	0,03%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	1,83%	2,77%	0,05%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	1,65%	8,69%	0,14%	
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1,25%	0,36%	0,00%	
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	1,67%	0,02%	
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	2,05%	0,33%	0,01%	
IMA-B 5				
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	2,95%	3,90%	0,12%	
BRDESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	2,97%	0,82%	0,02%	
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	2,84%	0,91%	0,03%	
IMOBILIARIO				
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	-0,15%	0,87%	0,00%	

FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	-12,57%	0,09%	 -0,01%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	-2,32%	0,64%	 -0,01%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	2,31%	1,98%	 0,05%
IPCA			
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,39%	1,38%	 0,02%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,39%	2,50%	 0,03%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	0,69%	0,68%	 0,00%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	-0,21%	3,17%	 -0,01%
TITULOS (NTN-B)	1,61%	11,26%	 0,18%
IRF-M 1			
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1,62%	7,64%	 0,12%
N/A			
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS (CONTAS CORRENTES HORTOPREV)	0,00%	0,05%	 0,00%
IMÓVEIS (TERRENOS)	0,00%	0,22%	 0,00%
OUTROS			
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	-0,14%	0,69%	 0,00%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	-0,13%	3,19%	 0,00%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-4,76%	0,63%	 -0,03%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	-3,62%	0,02%	 0,00%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	-3,62%	0,02%	 0,00%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	-3,62%	0,01%	 0,00%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	-0,07%	0,11%	 0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	0,98%	0,91%	 0,01%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,90%	1,30%	 0,01%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,45%	1,81%	 0,03%
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	1,21%	0,33%	 0,00%
SMLL			
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	-0,42%	0,55%	 0,00%
TRM			
TITULOS (TDA)	1,85%	0,46%	 0,01%

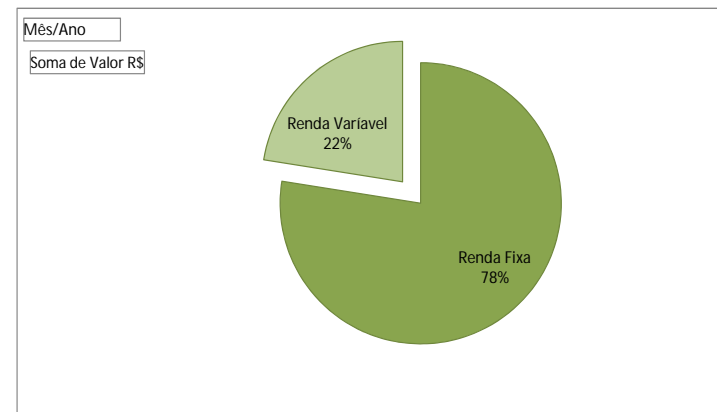
Enquadramento

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

Mês/Ano	janeiro-16	
Rótulos de Linha	Teto 25%	Teto 20%
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	1,44%	1,10%
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	5,42%	0,87%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	2,74%	4,04%
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	1,82%	0,69%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2,72%	0,80%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	0,96%	4,95%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	0,49%	1,81%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,20%	3,51%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,30%	9,69%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	0,14%	3,75%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	4,17%	1,15%
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	1,41%	1,04%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2,87%	0,41%
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	18,55%	0,57%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	0,64%	0,02%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	0,68%	0,03%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	0,34%	0,01%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	0,40%	0,14%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,60%	6,72%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4,52%	1,75%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7,24%	3,17%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	0,60%	11,06%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	1,12%	11,02%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,66%	0,85%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	2,17%	1,16%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	0,01%	0,11%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO AGENCIAS CAIXA - FII	0,44%	0,82%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	3,31%	0,86%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1,93%	0,46%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	2,54%	1,38%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	0,73%	0,81%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	5,02%	1,48%
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	6,05%	1,12%
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	0,81%	1,43%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	12,78%	1,65%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	14,12%	2,29%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,79%	2,11%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	2,53%	4,02%
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	2,23%	0,42%
OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD	0,26%	0,42%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	19,83%	2,41%
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	4,95%	2,31%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,46%	1,16%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	19,11%	2,51%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	5,40%	0,80%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	2,01%	1,12%

Situação	Enquadrado	Enquadrado

Mês/Ano	janeiro-16		
Rótulos de Linha	Soma de Valor R\$	%	Resultado
Renda Fixa	R\$ 228.091.397,03	77,52%	Enquadrado
Renda Variável	R\$ 66.152.270,15	22,48%	Enquadrado
Total Geral	R\$ 294.243.667,18	100,00%	



Mês/Ano	janeiro-16		
Artigos Resolução CMN 3922/2010	% Total	Limite	Situação
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	20,40%	100,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	15,71%	100,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso III - RF Ref.	19,03%	80,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso IV - RF	13,44%	30,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	3,50%	8,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	0,96%	2,00%	Enquadrado
Art. 7o, Inciso VII, Alínea B - Credito Privado	3,80%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	1,58%	30,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso III - FIA	9,41%	15,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso IV - FIM	3,86%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso V - FIP	3,98%	5,00%	Enquadrado
Art. 8o, Inciso VI - FII	3,58%	5,00%	Enquadrado
Em enquadramento - TP CETIP	0,46%	0,00%	Em enquadramento
Disponibilidades Financeiras	0,05%	N/A	N/A
Art. 9o - Imóveis	0,22%	N/A	N/A
Limite 15% PL (Soma Art. 9º VI e VII)	Art. 7º § 5º		Enquadrado

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, em porcentagem, que o Fundo pode perder em um mês em um cenário ruim, considerando seus dados seguem uma distribuição normal, quanto maior, pior).

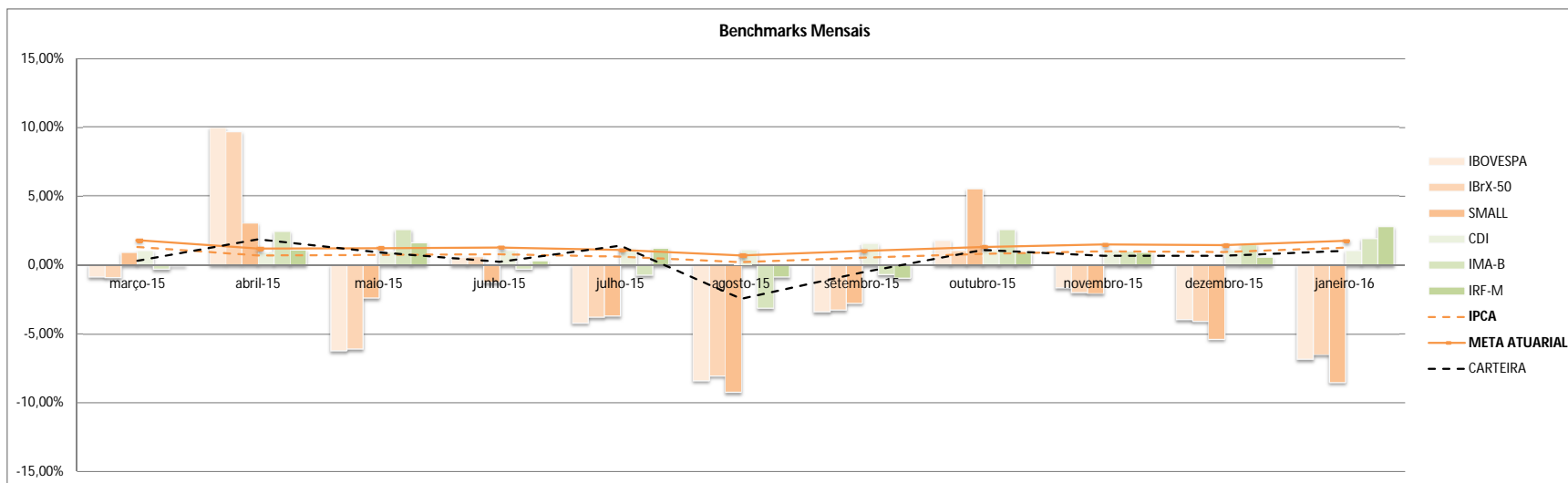
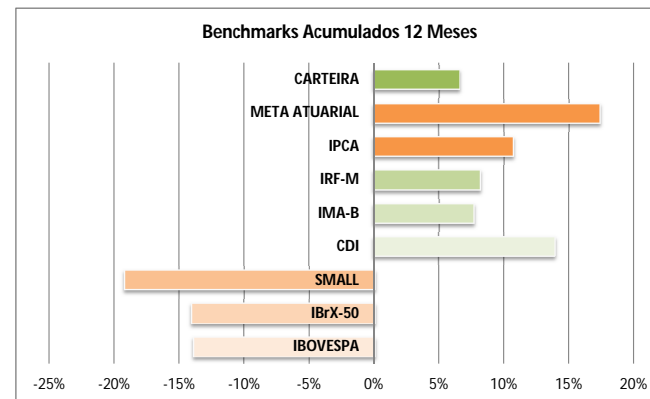
Nome do Fundo	Retorno 24 Meses	Retorno 12 Meses ²	Retorno Ano	Retorno Mês	Retorno Esperado	Risco (Volatilidade)	Sharpe	VaR ¹
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	7,83%	-1,45%	-0,15%	-0,15%	0,32%	2,31%	-8,48	4,13%
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	2,46%	-4,84%	-0,14%	-0,14%	0,11%	1,98%	-12,66	3,36%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	36,18%	37,41%	-0,13%	-0,13%	1,48%	7,90%	1,10	14,47%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	4,97%	-10,85%	-4,76%	-4,76%	-0,07%	4,32%	-7,25	7,04%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	31,66%	14,69%	2,95%	2,95%	1,00%	1,20%	0,59	2,98%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	29,94%	7,35%	1,88%	1,88%	0,97%	2,25%	-0,32	4,68%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	35,09%	11,88%	1,83%	1,83%	1,13%	2,24%	1,88	4,81%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	25,63%	13,28%	1,62%	1,62%	0,93%	0,23%	-5,53	1,31%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	26,28%	13,59%	1,05%	1,05%	0,97%	0,13%	-0,68	1,18%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	27,89%	12,61%	1,81%	1,81%	0,99%	0,50%	0,83	1,81%
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	21,72%	15,55%	2,97%	2,97%	1,10%	0,97%	-5,84	2,70%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-1,43%	0,21%	-1,19%	-1,19%	-0,17%	3,71%	-8,96	5,93%
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	-34,82%	-18,86%	-3,08%	-3,08%	-1,80%	4,38%	-14,92	5,41%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	-89,03%	-14,10%	-3,62%	-3,62%	50,26%	313,99%	-0,37	566,74%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	-99,34%	-14,75%	-3,62%	-3,62%	-11,86%	26,34%	-4,81	31,47%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	-99,70%	-14,75%	-3,62%	-3,62%	-15,71%	27,10%	-4,69	28,87%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	1,39%	-48,40%	-0,07%	-0,07%	2,33%	27,98%	-1,15	48,36%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	33,68%	16,61%	2,87%	2,87%	1,13%	0,93%	5,45	2,67%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	30,27%	16,99%	1,39%	1,39%	1,12%	0,42%	10,92	1,82%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	39,58%	16,31%	1,39%	1,39%	1,41%	1,49%	9,42	3,86%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	25,89%	13,44%	1,05%	1,05%	0,96%	0,13%	-3,45	1,17%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	29,18%	7,16%	1,65%	1,65%	0,96%	2,12%	-0,50	4,44%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	12,07%	5,00%	-1,35%	-1,35%	0,24%	3,59%	-6,35	6,15%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	15,40%	7,05%	0,98%	0,98%	0,64%	1,22%	-8,51	2,65%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	-19,78%	-17,02%	-12,57%	-12,57%	-0,81%	3,79%	-12,45	5,43%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	18,83%	1,10%	-2,32%	-2,32%	0,74%	2,05%	-3,76	4,11%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	25,97%	13,15%	0,69%	0,69%	0,95%	0,47%	-1,68	1,72%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	7,72%	3,15%	1,25%	1,25%	0,29%	1,83%	-11,17	3,29%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1,31%	3,28%	-8,03%	-8,03%	-0,09%	5,30%	-6,22	8,62%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	9,27%	3,94%	-5,82%	-5,82%	0,28%	5,06%	-4,64	8,59%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	4,84%	2,59%	-7,02%	-7,02%	-0,01%	4,80%	-6,32	7,88%
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	28,09%	14,88%	1,26%	1,26%	1,04%	0,73%	2,76	2,23%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-7,96%	-6,62%	-3,51%	-3,51%	-0,52%	4,85%	-8,66	7,47%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	3,37%	-7,06%	0,90%	0,90%	0,17%	2,74%	-8,74	4,68%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-8,59%	-17,08%	1,45%	1,45%	-0,34%	6,12%	-6,44	9,73%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12,87%	-0,45%	1,04%	1,04%	0,44%	2,10%	-7,79	3,90%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	28,61%	12,33%	-0,21%	-0,21%	1,07%	0,56%	5,25	2,00%
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	29,62%	13,23%	2,05%	2,05%	0,96%	1,57%	-0,53	3,54%
OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD	30,12%	15,52%	1,21%	1,21%	1,10%	0,14%	27,52	1,34%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-99,41%	-99,44%	-0,15%	-0,15%	-4,08%	20,22%	-6,27	29,18%
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-7,19%	-7,67%	-3,25%	-3,25%	-0,50%	4,70%	-8,82	7,23%
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	-1,21%	3,73%	-0,42%	-0,42%	-0,33%	4,48%	-8,41	7,03%
AZ QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	24,01%	11,90%	1,57%	1,57%	0,90%	0,35%	-6,83	1,48%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	17,59%	2,53%	2,84%	2,84%	0,63%	1,99%	-5,57	3,90%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	12,73%	4,42%	2,31%	2,31%	0,50%	1,62%	-8,96	3,16%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-11,05%	-13,19%	-2,70%	-2,70%	-0,64%	4,17%	-10,55	6,21%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)	33,27%	17,35%	1,76%	1,76%	1,20%	0,34%	21,33	1,76%
CDI (ATIVO LIVRE DE RISCO)	26,32%	13,90%	1,05%	1,05%	0,97%	0,17%	0,00	1,26%

¹VaR Paramétrico Normal, horizonte de 21 dias, 95% de probabilidade.

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	IPCA	META ATUARIAL	CARTEIRA
fevereiro-15	9,97%	9,81%	5,68%	0,82%	0,54%	0,29%	1,22%	1,71%	1,12%
março-15	-0,84%	-0,88%	0,92%	1,04%	-0,28%	-0,03%	1,32%	1,81%	0,32%
abril-15	9,93%	9,66%	3,04%	0,95%	2,44%	1,09%	0,71%	1,20%	1,88%
maio-15	-6,17%	-6,05%	-2,37%	0,98%	2,57%	1,63%	0,74%	1,23%	0,93%
junho-15	0,61%	0,64%	-1,24%	1,06%	-0,27%	0,32%	0,79%	1,28%	0,24%
julho-15	-4,17%	-3,75%	-3,66%	1,18%	-0,73%	1,23%	0,62%	1,11%	1,42%
agosto-15	-8,33%	-7,98%	-9,16%	1,11%	-3,11%	-0,85%	0,22%	0,71%	-2,45%
setembro-15	-3,36%	-3,24%	-2,73%	1,57%	-0,68%	-0,94%	0,54%	1,03%	-0,53%
outubro-15	1,80%	1,05%	5,54%	1,11%	2,58%	0,92%	0,82%	1,31%	1,10%
novembro-15	-1,63%	-1,98%	-2,03%	1,06%	1,03%	0,92%	1,01%	1,50%	0,67%
dezembro-15	-3,93%	-4,04%	-5,34%	1,16%	1,52%	0,57%	0,96%	1,45%	0,67%
janeiro-16	-6,79%	-6,46%	-8,46%	1,05%	1,91%	2,79%	1,27%	1,76%	1,04%
Acumulado	-13,85%	-14,01%	-19,19%	13,90%	7,61%	8,18%	10,71%	17,35%	6,53%
Média	-2,08%	-2,09%	-2,32%	1,12%	0,63%	0,70%	0,82%	1,31%	0,48%
Volatilidade	5,06%	4,84%	4,45%	0,17%	1,81%	1,07%	0,32%	0,32%	1,16%



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.

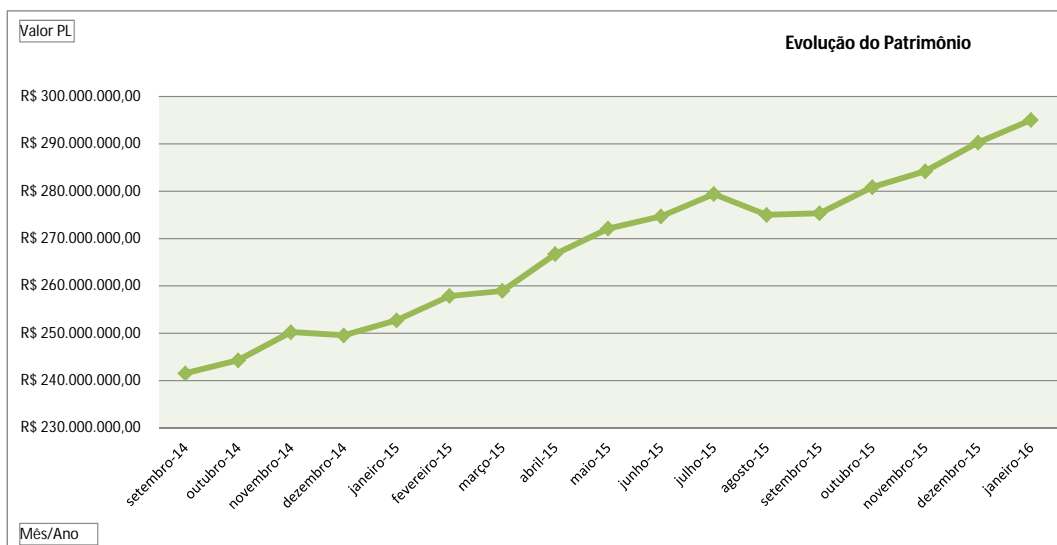
Patrimônio

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
outubro-15	R\$ 280.874.005,62
novembro-15	R\$ 284.221.743,98
dezembro-15	R\$ 290.286.158,31
janeiro-16	R\$ 295.042.820,50

Aplicações e Resgates

Ano	2.016
Mês	1

Tabela Resumida de Aplicações e Resgates		
Fundo	Aplicação	Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 7.949.188,29	R\$ 1.160.000,00
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES		R\$ 2.000.000,00
BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA INSTITUCIONAL FI EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES		R\$ 2.572.188,29
Total Geral	R\$ 7.949.188,29	R\$ 5.732.188,29



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
EQUITAS ADMINISTRAÇÃO DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS LTDA	082048170001-93	CRENCIADO	03/09/2015	01/03/2016	078/2015	Concluído
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA	074372410001-41	CRENCIADO	09/09/2015	07/03/2016	090/2015	Concluído
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	072508640001-00	CRENCIADO	15/09/2015	13/03/2016	106/2015	Concluído
FMD GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	104461310001-50	CRENCIADO	25/09/2015	23/03/2016	121/2015	Concluído
INFINITY ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	034031810001-95	CRENCIADO	01/10/2015	29/03/2016	136/2015	Concluído
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	308229360001-69	CRENCIADO	06/10/2015	03/04/2016	125/2015	Concluído
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	623751340001-44	CRENCIADO	14/10/2015	11/04/2016	049/2015	Concluído
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	028881520001-06	CRENCIADO	16/10/2015	13/04/2016	137/2015	Concluído
TERCON INVESTIMENTOS LTDA	091214540001-95	CRENCIADO	21/10/2015	18/04/2016	175/2015	Concluído
J. MALUCELLI DTVM LTDA.	766214570001-85	CRENCIADO	22/10/2015	19/04/2016	174/2015	Concluído
RIO BRAVO INVESTIMENTOS DTVM LTDA	726000260001-81	CRENCIADO	26/10/2015	23/04/2016	190/2015	Concluído
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	038646070001-08	CRENCIADO	26/10/2015	23/04/2016	191/2015	Concluído
FOCO DTVM LTDA.	003295980001-67	CRENCIADO	03/11/2015	01/05/2016	198/2015	Concluído
GENUS CAPITAL GROUP GESTAO DE RECURSOS LTDA	101723640001-02	CRENCIADO	09/11/2015	07/05/2016	152/2015	Concluído
AQUILLA ASSET MANAGEMENT	089645450001-20	CRENCIADO	10/11/2015	08/05/2016	197/2015	Concluído
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	003603050001-04	CRENCIADO	30/11/2015	28/05/2016	238/2015	Concluído
LEME INVESTIMENTOS LTDA	741989120001-56	CRENCIADO	07/12/2015	04/06/2016	256/2015	Concluído
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA	110107790001-42	CRENCIADO	23/12/2015	20/06/2016	277/2015	Concluído
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	045063940001-05	CRENCIADO	23/12/2015	20/06/2016	278/2015	Concluído
GF GESTÃO DE RECURSOS S.A.	096301880001-26	CRENCIADO	14/01/2016	12/07/2016	280/2015	Concluído