


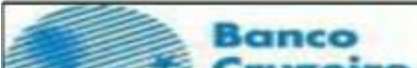





RELATORIO DOS INVESTIMENTOS HORTOPREV - EXERCICIO - 2011


JUNHO - 2012


|  | TIPO DE APLICAÇÃO | REND A FIXA | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark | |
|--|---|----------------------|---------------|-------------|--------------------|-------------------|------------|--|
| | BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B FI | | 8.891.329,88 | -0,4248 | 2,24787030 | 3.955,44612 | IMA-B | |
| | BB PREVIDENCIARIO RF IRF- M TITULOS PUBLICOS | | 2.811.352,85 | 1,2875 | 2,57883262 | 1.090,16492 | IRFM-IMA-B | |
| | BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TITULOS PUBLICOS | | 7.898.057,84 | -0,3897 | 2,54653897 | 3.101,48713 | IRFM-IMA-B | |
| | BB PREVIDENCIARIO RF IRF- M1 TITULOS PUBLICOS FIC | | 62.619,92 | 0,7156 | 1,32440840 | 47,281427821 | IRFM | |
| | BB PREVIDENCIARIO RF IRF- M1 TITULOS PUBLICOS FIC 6.252-9 | | 655.429,74 | 0,7156 | 1,32440840 | 494.884,908703 | IRFM | |
| | BB PREVIDENCIARIO RF IRF- M1 TITULOS PUBLICOS FIC 130-9 | | 780.122,98 | 0,7156 | 1,32440840 | 564.387,872605 | IRFM | |
| TIPO DE APLICAÇÃO | REND A VARIAVEL | | | | | | | |
| BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO | | 1.711.863,88 | -0,4901 | 21,72629161 | 78.792,272083 | IBOVESPA | | |
| TIPO DE APLICAÇÃO | REND A FIXA | | | | | | | |
| BB RPPS RF FLUXO FIC | | | | | | CDI | | |
| TOTAL POR BANCO | | 22.810.777,09 | | | | | | |
|  | TIPO DE APLICAÇÃO | REND A FIXA | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark | |
| | CAIXA FI NOVO BRASIL RF CRED. PRIV L | | 24.836.557,24 | -0,8453 | 1,521045 | 16.328.614,357359 | IMA-B | |
| | FI CAIXA BRASIL IPCA XIII RF CRED. P | | 4.845.328,00 | -0,5879 | 1,211332 | 4.000.000,000000 | IPCA | |
| | CAIXA FIC PRATICO CP | | 6.200.000,00 | 0,2418 | 4,353928 | 1.424,001499335 | IPCA | |
| | TIPO DE APLICAÇÃO | FUND O MULTIMERCADOS | | | | | | |
| | FI CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO | | 2.670.807,90 | 0,9303 | 1,136514 | 2.350.000,000000 | CDI | |
| | TIPO DE APLICAÇÃO | REND A VARIAVEL | | | | | | |
| CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX-50 | | 1.834.256,91 | 0,6168 | 0,768956 | 2.385.385,108004 | IBX-50 | | |
| TOTAL POR BANCO | | 40.386.950,05 | | | | | | |
|  | TIPO DE APLICAÇÃO | REND A VARIAVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark | |
| | SCHRODER FIA | | 7.329.066,99 | 0,76 | 1,1701822 | 6.263.184,4790300 | IBX 50 | |
| | TIPO DE APLICAÇÃO | REND A FIXA | | | | | | |
| | SCHRODER RPPS FI RF | | 563.684,32 | -0,38 | 1,4248553 | 395.608,11693 | IMA-B | |
| TOTAL POR BANCO | | 7.892.751,31 | | | | | | |
|  | TIPO DE APLICAÇÃO | FIDIC | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark | |
| | FIDC TREND BANK - BANCO DE FOMENTO MULTISSETORIAL | | 1.076.846,26 | 0,77 | 11,096,96293385 | 97,03972800 | CDI | |


| | | | | | | |
|--|---|---------------------|------|-----------------|--------------|-----|
|  | FIDC TREND BANK - BANCO DE FOMENTO MULTISSETORIAL | 2.010.883,44 | 0,76 | 10.118,15703247 | 198.74009014 | CDI |
| | FIDC BCSUL CREDITO CONSIGNADO II | 4.710.286,78 | 0,71 | 11.924,55234825 | 395.00743061 | CDI |
| | TOTAL POR BANCO | 7.798.016,48 | | | | |


| | | | | | | |
|--|--------------------------------|---------------------|----------|---------------------------|--------------------|------------------|
|  | TIPO DE APLICAÇÃO FIDIC | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| | FUNDO - RURAL FIDC PREMIUM | 6.238.957,51 | 0,66 | 3,07220711 | 2.030.773,7350 | CDI |
| | TOTAL POR BANCO | 6.238.957,51 | | | | |

| | | | | | | |
|--|---|---------------------|----------|---------------------------|--------------------|------------------|
|  | TIPO DE APLICAÇÃO FIDIC | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| | FUNDO - BMG FIDIC ABERTO CREDITO CONSIGNADO | 4.513.011,91 | 0,66 | 1.166,45435827 | 3.869,0 | CDI |
| | TOTAL POR BANCO | 4.513.011,91 | | | | |

| | | | | | | |
|--|---|----------------------|----------|---------------------------|--------------------|------------------|
|  | TIPO DE APLICAÇÃO TITULOS PUBLICOS | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| | NTN-B | 32.638.171,67 | -1,56 | cotas dif. | 12.866 | IPCA |
| | NTN-C | 23.930.378,45 | -0,84 | cotas dif. | 7.928 | IGPM-M |
| | TDA | 3.281.265,30 | 0,97 | cotas dif. | 40.613 | IR |
| | TOTAL POR BANCO | 59.849.815,42 | | | | |

| | | | | | | |
|--|--|------------------|----------|---------------------------|--------------------|------------------|
|  | TIPO DE APLICAÇÃO RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| | FUNDO - SANTANDER FI INSTITUCIONAL AÇÕES | 1.092.994,91 | -0,97 | 9,7268725 | 112.368,586946 | IBOVESPA |
| | TIPO DE APLICAÇÃO RENDA FIXA | | | | | |
| | FUNDO - SANTANDER FIC FI RF IMA-B TIT. PUBL. | 810.724,52 | -0,44 | 150,626104 | 5.382,364028 | IMA- B |
| TOTAL POR BANCO | 1.903.719,43 | | | | | |

| | | | | | | |
|--|---|-------------------|----------|---------------------------|--------------------|------------------|
|  | TIPO DE APLICAÇÃO RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| | FUNDO - Gwi Classic Fia | 405.724,68 | 1,17 | 439.730,25593460 | 0,92266719 | IBOVESPA |
| | TOTAL POR BANCO | 405.724,68 | | | | |

| | | | | | | |
|--|---|---------------------|----------|---------------------------|--------------------|------------------|
|  | TIPO DE APLICAÇÃO RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| | FUNDO - HUMAITA VALUE FIA | 978.313,08 | 0,13 | 3,35238685 | 291.825,83022974 | IBOVESPA |
| | FUNDO - HUMAITA EQUITY HEDGE FIM | 409.409,05 | 0,93 | 1,28599602 | 318359,503661 | |
| | TOTAL POR BANCO | 1.387.722,13 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|--|----------------|--------------|------|--------------------|-----------------|-----------|
| FUNDO - ITAU RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FI | | 3.462.415,36 | 1,56 | 1,2379090 | 2.796.987,00509 | IBOVESPA |
| TOTAL POR BANCO | | 3.462.415,36 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA FIXA | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|---|----------------|--------------|--------|--------------------|-----------------|-----------|
| FUNDO -BRADESCO FI RENDA FIXA IMA-B | | 644.016,49 | -0,49 | 1,953385000 | 329.692,5567500 | IMA-B |
| FUNDO - BRADESCO FI RF IMA- B TIT.PUBL. | | 1.202.418,70 | -0,52 | 1,466323700 | 820.022,6897600 | IMA-B |
| TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| FUNDO - BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS | | 380.218,27 | (0,25) | 434,397895390 | 875,276495000 | IBOVESPA |
| TOTAL POR BANCO | | 2.226.653,46 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA FIXA | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|---------------------|----------------|------------|------|--------------------|-------------|-----------|
| FUNDO - IMA RF. FIC | | 780.422,79 | 0,67 | 133,506544 | 5845,577033 | IMA RF |
| TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| TOTAL POR BANCO | | 780.422,79 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | FIDIC | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|-------------------------|-------|------------|------|--------------------|-------------|-----------|
| FUNDO - OURINVEST FIDIC | | 647.664,23 | 0,73 | 179,288489 | 3.612,41393 | CDI |
| TOTAL POR BANCO | | 647.664,23 | | | | |









| TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|----------------------------|----------------|------------|------|--------------------|-------------|-----------|
| FUNDO -GRAU SAVANAINST.FIM | | 612.129,48 | 0,78 | 10,8880604 | 56.220,25 | CDI |
| TOTAL POR BANCO | | 612.129,48 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|---------------------------|----------------|--------------|------|--------------------|---------------|-----------|
| FUNDO - MARLIM DIVIDENDOS | | 1.256.133,41 | 4,10 | 1,8274992 | 687.351,00999 | IBOVESPA |
| TOTAL POR BANCO | | 1.256.133,41 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA FIXA | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|------------------------------------|------------|------------|-------|--------------------|----------------|-----------|
| FUNDO - BNP PARIBAS INFLAÇÃO FI RF | | 568.116,73 | -0,26 | 446,50948400 | 1.272,35087530 | IMA-B |

| ASSET MANAGEMENT | | | | | | | |
|--|--|-----------------------|--------------|-------|--------------------|-----------------|-----------|
| TOTAL POR BANCO | | 568.116,73 | | | | | |
|  | TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| | FUNDO - LMX PREVIDENCIARIO FI AÇÕES | | 1.585.484,30 | -4,79 | 0,63511761 | 2.496.363,30793 | IBOVESPA |
| | FUNDO - LMX DIVIDENDOS FIA | | 389.133,28 | 2,57 | 1,16443851 | 334.181,044820 | |
| | TOTAL POR BANCO | | 1.974.617,58 | | | | |
|  | TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| | FUNDO - ROMA AÇÕES FIA | | | | | | |
| | TOTAL POR BANCO | | 0,00 | | | | |
| | | | | | | | |
|  Criando valor para você. | TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| | FUNDO - GERAÇÃO FIA | | 791.966,11 | -0,94 | 117,9048067 | 6716,9960400 | IBOVESPA |
| | FUNDO - GERAÇÃO FUT. DIVID. FUNDO INVESTIM. EM AÇÕES | | 943.691,19 | 2,90 | 1,3693297 | 689162,86743000 | IBOVESPA |
| | FUNDO - GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO INVEST. | | 480.425,38 | -4,02 | 0,9331799 | 514826,11696410 | IBOVESPA |
| TOTAL POR BANCO | | 2.216.082,68 | | | | | |
|  | TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| | FUNDO - HSBC FIC FI AÇÕES REGIMES PREVIDENCIARIOS | | 1.312.183,60 | 1,37 | 1,0729578 | 1222,95920 | IBOVESPA |
| | TOTAL POR BANCO | | 1.312.183,60 | | | | |
| | | | | | | | |
|  | TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| | FUNDO - META VALOR FIA | | | | | | |
| | TOTAL POR BANCO | | 0,00 | | | | |
| | | | | | | | |
|  | TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| | FUNDO - BNY MELLON ARX FIA | | 1.312.129,13 | 1,68 | 11,09256505 | 118289,06296186 | IBOVESPA |
| | TOTAL POR BANCO | | 1.312.129,13 | | | | |
| | | | | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENTA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|-----------------------------|----------------|------------|------|--------------------|-----------------|-----------|
| FUNDO -PERFIN EQ 30 FIC FIA | | 405.956,01 | 2,13 | 1,71713170 | 236.415,1845450 | IBOVESPA |
| TOTAL POR BANCO | | 405.956,01 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENTA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|---|----------------|------------|---------|--------------------|--------------|-----------|
| FUNDO - MIRAE ASSET. INSTITUCIONAL AÇÕES FI | | 218.694,07 | -0,1992 | 0,903651 | 253.631,2384 | IBOVESPA |
| TOTAL POR BANCO | | 218.694,07 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENTA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|---|----------------|------------|-------|--------------------|----------------|-----------|
| FUNDO -CSHG STRATEGY INST. FIC FIA - IBOVESPA | | 232.712,89 | -0,92 | 9,6576725 | 24.096,1676900 | IBOVESPA |
| TOTAL POR BANCO | | 232.712,89 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENTA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|--------------------------------------|----------------|------------|------|--------------------|------------------|-----------|
| FUNDO INSTITUCIONAL FIM MULTIMERCADO | | 207.165,55 | 0,04 | 3,131124000 | 66.160,866839600 | CDI |
| TOTAL POR BANCO | | 207.165,55 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENTA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|---|----------------|------------|------|--------------------|----------------|-----------|
| QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | | 637.971,79 | 2,68 | 1,463898100 | 435.803,414420 | IBOVESPA |
| TOTAL POR BANCO | | 637.971,79 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENTA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|------------------------------------|----------------|--------------|-------|--------------------|--------------------|-----------|
| FUNDO ATICO GERAÇÃO DE ENERGIA FIP | | 6.350.091,35 | -0,14 | 1,27001827 | 5.000.000,00000000 | FIP |
| TIPO DE APLICAÇÃO | RENTA FIXA | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
| FUNDO ATICO INSTITUCIONAL FI | | 2.112.151,14 | 0,90 | 1,08155449 | 1952884,62736481 | IMA-B |
| TOTAL POR BANCO | | 8.462.242,49 | | | | |



associada ao ING

| TIPO DE APLICAÇÃO | RENTA FIXA | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|-------------------------|------------|------------|-------|--------------------|----------------|-----------|
| FUNDO INFLATIE FI RF LP | | 227.090,42 | -0,46 | 18,7408158 | 12.117,4245100 | IMA-B |
| TOTAL POR BANCO | | 227.090,42 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|-------------------|----------------|-----------|---|--------------------|-------------|-----------|
| | | | | | | |
| | | | | | | |
| TOTAL POR BANCO | | 0,00 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|--|----------------|------------|------|--------------------|-----------------|-----------|
| FUNDO -BTG PACTUAL FI MM LOCAL INSTITUCIONAL | | 217.497,03 | 0,80 | 4,076119000 | 53.358,85309400 | CDI |
| | | | | | | |
| TOTAL POR BANCO | | 217.497,03 | | | | |



| TIPO DE APLICAÇÃO | RENDA VARIÁVEL | Valor R\$ | % | Valor Un.das Cotas | Quant.Cotas | Benchmark |
|-------------------------|----------------|------------|-------|--------------------|---------------|-----------|
| FUNDO - XP INVESTOR FIA | | 869.181,93 | -3,33 | 3,33898645 | 260.313,10340 | IBOVESPA |
| | | | | | | |
| TOTAL POR BANCO | | 869.181,93 | | | | |

TOTAL

181.034.506,64