

## RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

HORTOPREV

### Resultado Mensal dos Investimentos destinados à Previdência

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 (apenas dos rendimentos), recebimentos de dividendos/amortizações/cupons de juros, rentabilidades no mês, ano e últimos 12 meses, além do risco (desvio-padrão) da série de 12 meses. Os valores de rendimento de cada conjunto de ativos (roxo) são as médias dos rendimentos de cada artigo de enquadramento. Inclui-se disponibilidades financeiras 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. O cálculo do resultado total da carteira é feito através da somatória da multiplicação da rentabilidade mensal de cada ativo pela proporção do mesmo na carteira no fechamento do mês (valor aproximado dado as movimentações mensais).

|  | No Mês | No Ano | 12 Meses |
|--|--------|--------|----------|
| <b>Meta Atuarial (IPCA)</b>                        | 0,65%  | 6,33%  | 8,69%    |
| <b>Resultado Hortoprev</b>                         | 1,47%  | 9,58%  | 10,93%   |
| Volatilidade da Carteira Hortoprev (Desvio Padrão) | -      | -      | 1,12%    |

### Mês/Ano Corrente

Destinação do Recurso

setembro-17

Previdência

| Artigo de Enquadramento / Ativo Financeiro  | Valor Total [R\$]         | Valor Mês [R\$]         | Recebimentos [R\$]  | Mês [%] | Ano [%] | 12 Meses [%] | Risco [%] |
|---|---------------------------|-------------------------|---------------------|---------|---------|--------------|-----------|
| <b>Art. 7o, Inciso I, Alínea A - Títulos Públicos</b>   | <b>R\$ 73.478.197,91</b>  | <b>R\$ 1.276.230,75</b> | <b>R\$ -</b>        |         |         |              |           |
| TESOURO IPCA+ 760199 (NTN-B)  | R\$ 42.936.403,11         | R\$ 794.518,91          | R\$ -               | 1,89%   | 14,42%  | 19,29%       | 1,84%     |
| TESOURO IGPM+ 770100 (NTN-C)  | R\$ 30.541.794,80         | R\$ 481.711,84          | R\$ -               | 1,60%   | 8,79%   | 5,42%        | 1,69%     |
| <b>Art. 7o, Inciso I, Alínea B - Fundos Exclusivos de Títulos Públicos</b>                    | <b>R\$ 174.866.842,70</b> | <b>R\$ 1.707.448,17</b> | <b>R\$ -</b>        |         |         |              |           |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                     | R\$ 23.944.320,66         | R\$ 418.931,67          | R\$ -               | 1,78%   | 12,94%  | 15,46%       | 1,75%     |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                   | R\$ 73.620.024,92         | R\$ 522.806,85          | R\$ -               | 0,71%   | 8,94%   | 12,38%       | 0,16%     |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                        | R\$ 10.468.005,38         | R\$ 52.015,22           | R\$ -               | 0,50%   | 8,50%   | 10,65%       | 0,39%     |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO       | R\$ 43.873.169,83         | R\$ 387.752,18          | R\$ -               | 0,89%   | 10,30%  | 12,77%       | 0,55%     |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO              | R\$ 22.961.321,91         | R\$ 325.942,25          | R\$ -               | 1,44%   | 13,36%  | 17,22%       | 0,72%     |
| <b>Art. 7o, Inciso III, Alínea A - Fundo de RF ou Referenciado (IMA/IDKA)</b>                 | <b>R\$ 25.714.241,04</b>  | <b>R\$ 315.819,74</b>   | <b>R\$ -</b>        |         |         |              |           |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO                                      | R\$ 13.203.346,20         | R\$ 239.160,62          | R\$ -               | 1,84%   | 13,20%  | 15,81%       | 1,77%     |
| BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA   | R\$ 2.488.417,59          | R\$ 4.887,95            | R\$ -               | 0,20%   | -6,27%  | -14,79%      | 5,13%     |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B                              | R\$ 1.435.646,65          | R\$ -11.661,15          | R\$ -               | -0,81%  | 11,42%  | 15,86%       | 1,86%     |
| TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA  | R\$ 1.242.882,22          | R\$ 15.523,19           | R\$ -               | 1,26%   | 11,69%  | 14,94%       | 1,15%     |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5                                      | R\$ 639.566,64            | R\$ -3.264,63           | R\$ -               | -0,51%  | 5,90%   | 8,18%        | 1,07%     |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5   | R\$ 2.376.741,80          | R\$ 24.039,53           | R\$ -               | 1,02%   | 7,28%   | 9,73%        | 0,66%     |
| LME REC IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA   | R\$ 4.327.639,94          | R\$ 47.134,23           | R\$ -               | 1,10%   | -10,80% | -24,23%      | 6,33%     |
| <b>Art. 7o, Inciso IV, Alínea A - Fundo de Renda Fixa</b>                                     | <b>R\$ 45.138.215,87</b>  | <b>R\$ 291.342,98</b>   | <b>R\$ -</b>        |         |         |              |           |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO  | R\$ 45.138.215,87         | R\$ 291.342,98          | R\$ -               | 0,65%   | 8,10%   | 11,65%       | 0,16%     |
| <b>Art. 7o, Inciso VI - FIDC Cota Senior (Aberto)</b>   | <b>R\$ 1.983.717,90</b>   | <b>R\$ 48.165,26</b>    | <b>R\$ -</b>        |         |         |              |           |
| LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS                   | R\$ 1.983.717,90          | R\$ 48.165,26           | R\$ -               | 2,49%   | -44,76% | -53,37%      | 14,95%    |
| <b>Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC Cota Senior (Fechado)</b>                             | <b>R\$ 2.270.820,13</b>   | <b>R\$ -2.690,23</b>    | <b>R\$ 4.481,69</b> |         |         |              |           |
| FIDC TRENBANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2   | R\$ 35.993,50             | R\$ 3.315,08            | R\$ -               | 9,96%   | -23,59% | -29,99%      | 5,05%     |
| FIDC TRENBANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3   | R\$ 37.991,99             | R\$ 3.441,51            | R\$ -               | 9,96%   | -23,59% | -30,45%      | 5,05%     |
| FIDC TRENBANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4   | R\$ 19.107,64             | R\$ 1.730,88            | R\$ -               | 9,96%   | -23,59% | -29,99%      | 5,05%     |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM                                  | R\$ 2.177.727,00          | R\$ -11.177,70          | R\$ 4.481,69        | -0,31%  | -3,52%  | -4,09%       | 0,32%     |
| <b>Art. 8o, Inciso III - Fundos de Ações</b>  | <b>R\$ 41.486.171,77</b>  | <b>R\$ 1.792.419,45</b> | <b>R\$ -</b>        |         |         |              |           |
| AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES   | R\$ 8.613.880,22          | R\$ 518.682,71          | R\$ -               | 6,41%   | 23,33%  | 25,71%       | 6,02%     |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES   | R\$ 2.710.393,63          | R\$ 149.160,82          | R\$ -               | 5,82%   | 39,50%  | 42,82%       | 6,33%     |
| BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO                     | R\$ 2.864.684,05          | R\$ 188.615,23          | R\$ -               | 7,05%   | 31,06%  | 18,59%       | 4,88%     |
| BRZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES                   | R\$ 1.465.376,06          | R\$ 70.524,14           | R\$ -               | 5,06%   | 21,21%  | 23,78%       | 4,84%     |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | R\$ 2.719.600,12          | R\$ 115.781,84          | R\$ -               | 4,45%   | 20,02%  | 19,45%       | 3,93%     |
| GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | R\$ 6.410.954,35          | R\$ 246.549,44          | R\$ -               | 4,00%   | 5,13%   | 12,56%       | 5,12%     |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES                                      | R\$ -                     | R\$ 123.527,76          | R\$ -               | 2,92%   | 3,81%   | 4,35%        | 5,27%     |
| GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES   | R\$ 4.326.563,86          | R\$ 100.501,91          | R\$ -               | 2,38%   | 7,56%   | 11,32%       | 5,34%     |
| QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES   | R\$ 8.064.253,12          | R\$ 324.504,09          | R\$ -               | 4,19%   | 20,89%  | 18,13%       | 4,04%     |

|   |            |                       |             |                     |            |                  |        |        |         |        |
|---|------------|-----------------------|-------------|---------------------|------------|------------------|--------|--------|---------|--------|
| BNP PARIBAS ACTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO AÇÕES                 | R\$        | 4.310.466,36          | -R\$        | 45.428,49           | R\$        | -                | 2,79%  | 16,80% | 25,33%  | 2,01%  |
| <b>Art. 8o, Inciso IV - Fundos Multimercado</b>   | <b>R\$</b> | <b>6.420.969,67</b>   | <b>R\$</b>  | <b>37.086,94</b>    | <b>R\$</b> | <b>-</b>         |        |        |         |        |
| FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO                                       | R\$        | 2.271.526,07          | R\$         | 7.511,30            | R\$        | -                | 0,33%  | 4,39%  | 7,24%   | 1,04%  |
| LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO        | R\$        | 4.149.443,60          | R\$         | 29.575,64           | R\$        | -                | 0,72%  | 9,10%  | -28,87% | 10,64% |
| <b>Art. 8o, Inciso V - Fundos de Participação</b>   | <b>R\$</b> | <b>11.441.540,88</b>  | <b>-R\$</b> | <b>17.073,73</b>    | <b>R\$</b> | <b>-</b>         |        |        |         |        |
| ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL | R\$        | 1.968.054,28          | -R\$        | 2.883,02            | R\$        | -                | -0,15% | -1,37% | -1,80%  | 0,01%  |
| ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP  | R\$        | 9.163.949,55          | -R\$        | 11.235,50           | R\$        | -                | -0,12% | -1,15% | -1,53%  | 0,01%  |
| FIP BRASIL ÓLEO E GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - MULTIESTRATÉGIA                    | R\$        | 309.537,05            | -R\$        | 2.955,21            | R\$        | -                | -0,10% | -4,40% | -4,68%  | 0,97%  |
| <b>Art. 8o, Inciso VI - Fundos Imobiliários</b>   | <b>R\$</b> | <b>12.070.705,10</b>  | <b>R\$</b>  | <b>208.545,88</b>   | <b>R\$</b> | <b>17.010,05</b> |        |        |         |        |
| AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO   | R\$        | 2.525.841,26          | -R\$        | 6.234,14            | R\$        | -                | -0,25% | -2,84% | -3,02%  | 0,67%  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND                         | R\$        | 308.954,28            | R\$         | 13.568,28           | R\$        | 1.050,05         | 4,96%  | 4,85%  | 5,07%   | 5,25%  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO AGENCIAS CAIXA - FII  | R\$        | 2.556.120,00          | R\$         | 72.120,00           | R\$        | 15.960,00        | 2,90%  | 9,57%  | 6,74%   | 3,78%  |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO                                | R\$        | 6.679.789,56          | R\$         | 129.091,74          | R\$        | -                | 1,97%  | 9,13%  | 11,40%  | 0,79%  |
| <b>Desenquadrado</b>  | <b>R\$</b> | <b>728.765,33</b>     | <b>R\$</b>  | <b>7.874,86</b>     | <b>R\$</b> | <b>-</b>         |        |        |         |        |
| TÍTULOS DA DÍVIDA AGRÁRIA (TDA)   | R\$        | 728.765,33            | R\$         | 7.874,86            | R\$        | -                | 1,09%  | 11,60% | 15,15%  | 0,33%  |
| <b>Disponibilidades Financeiras</b>   | <b>R\$</b> | <b>343.488,10</b>     | <b>R\$</b>  | <b>-</b>            | <b>R\$</b> | <b>-</b>         |        |        |         |        |
| BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 30300-3 / HORTOPREV  | R\$        | -                     | R\$         | -                   | R\$        | -                |        |        |         |        |
| BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 61-2 / BENEFÍCIO   | R\$        | 236.660,23            | R\$         | -                   | R\$        | -                |        |        |         |        |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL / 4088 / 10-8   | R\$        | 101.776,33            | R\$         | -                   | R\$        | -                |        |        |         |        |
| SANTANDER / 0178 / 45-002818-8  | R\$        | 5.051,54              | R\$         | -                   | R\$        | -                |        |        |         |        |
| BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 130313-9 / COMPREV   | R\$        | -                     | R\$         | -                   | R\$        | -                |        |        |         |        |
| ITAU / 9183 / 12159-0   | R\$        | -                     | R\$         | -                   | R\$        | -                |        |        |         |        |
| <b>Total Geral</b>  | <b>R\$</b> | <b>395.943.676,40</b> | <b>R\$</b>  | <b>5.665.170,07</b> | <b>R\$</b> | <b>21.491,74</b> |        |        |         |        |

\*O fundo BNP Paribas Action possui rendimentos negativos em R\$ e positivos em % pois: no mês inteiro ele rendeu +2,79%, entretanto a aplicação do instituto foi no final do mês (dia 18), cujo período de 11 dias gerou retornos negativos ao instituto. Tendo em vista este ser um relatório gerencial de comportamento dos fundos, acha-se por bem colocar o valor fechado do fundo no mês. Contudo para o cálculo da meta atuarial, neste fundo foi considerado o valor de -1,04%, referente ao resultado dele dentro da carteira do instituto.

#### Resultado Mensal Financeiro dos Recursos Utilizados para Custeio Administrativo

Esta tabela demonstra os valores aplicados e resgatados que são advindos da taxa de administração, segregados a partir de agosto de 2017 neste relatório, respeitando o Art. 64º da Lei Municipal 965/2001.

|                       |               |
|-----------------------|---------------|
| Mês/Ano Corrente      | setembro-17   |
| Destinação do Recurso | Administração |

| Ativos para uso da Administração   | Resgates [R\$]        | Aplicações [R\$]      | Valor Final [R\$]       | Mês [%] | Ano [%] | 12 Meses [%] | Risco [%] |
|--|-----------------------|-----------------------|-------------------------|---------|---------|--------------|-----------|
| <b>Art. 7o, Inciso I, Alinea B - Fundos Exclusivos de Títulos Públicos</b> | <b>R\$ 170.000,00</b> | <b>R\$ 330.000,00</b> | <b>R\$ 2.367.150,29</b> |         |         |              |           |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                | R\$ 170.000,00        | R\$ 330.000,00        | R\$ 2.367.150,29        | 0,71%   | 8,94%   | 12,38%       | 0,16%     |
| <b>Disponibilidades Financeiras</b>  | <b>R\$ -</b>          | <b>R\$ -</b>          | <b>R\$ 63.470,60</b>    |         |         |              |           |
| BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 130-9 / CUSTEIO                                 | R\$ -                 | R\$ -                 | R\$ 63.470,60           |         |         |              |           |
| BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 5687-1 / PATROCÍNIO                             | R\$ -                 | R\$ -                 | R\$ -                   |         |         |              |           |
| BANCO DO BRASIL / 6983-3 / 6252-9 / CONSTRUÇÃO                             | R\$ -                 | R\$ -                 | R\$ -                   |         |         |              |           |
| <b>Imóveis</b>   | <b>R\$ -</b>          | <b>R\$ -</b>          | <b>R\$ 661.500,00</b>   |         |         |              |           |
| LOTE 09 - QUADRA 6A - R. JOSE DE CAMARGO - HORTOLÂNDIA-SP                  | R\$ -                 | R\$ -                 | R\$ 189.000,00          |         |         |              |           |
| LOTE 10 - QUADRA 6A - R. JOSE DE CAMARGO - HORTOLÂNDIA-SP                  | R\$ -                 | R\$ -                 | R\$ 189.000,00          |         |         |              |           |
| LOTE 11 - QUADRA 6A - R. JOSE DE CAMARGO - HORTOLÂNDIA-SP                  | R\$ -                 | R\$ -                 | R\$ 283.500,00          |         |         |              |           |
| <b>Total Geral</b>   | <b>R\$ 170.000,00</b> | <b>R\$ 330.000,00</b> | <b>R\$ 3.092.120,89</b> |         |         |              |           |

## Proporções

Estes dados mostram as proporções da carteira, apontando se o Hortoprev está enquadrado (ou não) em determinados parâmetros da Resolução CMN 3922/2010 (para consulta de ativos desenquadrados, ver página anterior). Além de demonstrar as proporções de aplicações nos seguimentos analisados e seus benchmarks. Ressalta-se que o enquadramento é baseado em relatórios divulgados pela consultoria de investimentos atuante no instituto.

### Limites Por Patrimônio Líquido do Fundo e Proporção da Carteira do Instituto

setembro-17

Destinação do Recurso

Previdência

Por P.L. do Fundo (Limite de 25% - Art. 14º) e por Total da Carteira (Limite de 20% Art. 13º - Para 7º III, IV e 8º I)

| Fundos  | % P.L. Fundo (25%) | % Carteira (20%) | Enquadramento |
|---|--------------------|------------------|---------------|
| AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO   | 1,38%              | 0,64%            | Enquadrado    |
| ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL | 5,42%              | 0,50%            | Enquadrado    |
| ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP  | 2,72%              | 2,32%            | Enquadrado    |
| AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES   | 6,31%              | 2,18%            | Enquadrado    |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES   | 0,80%              | 0,69%            | Enquadrado    |
| BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO                         | 2,36%              | 0,72%            | Enquadrado    |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO  | 1,01%              | 3,34%            | Enquadrado    |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                         | 0,44%              | 6,05%            | Enquadrado    |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                       | 0,66%              | 18,61%           | Enquadrado    |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO      | 1,05%              | 11,41%           | Enquadrado    |
| BNP PARIBAS ACTION FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO AÇÕES                 | 0,64%              | 1,09%            | Enquadrado    |
| BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA   | 4,17%              | 0,63%            | Enquadrado    |
| BRZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES                       | 5,21%              | 0,37%            | Enquadrado    |
| FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2   | 2,01%              | 0,01%            | Enquadrado    |
| FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3   | 3,75%              | 0,01%            | Enquadrado    |
| FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4   | 2,88%              | 0,00%            | Enquadrado    |
| FIP BRASIL ÓLEO E GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - MULTIESTRATÉGIA                    | 0,40%              | 0,08%            | Enquadrado    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                            | 0,33%              | 2,65%            | Enquadrado    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO           | 1,19%              | 11,09%           | Enquadrado    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                  | 0,74%              | 5,80%            | Enquadrado    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS     | 0,65%              | 0,69%            | Enquadrado    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM                                      | 2,17%              | 0,55%            | Enquadrado    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND                         | 0,01%              | 0,08%            | Enquadrado    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO AGENCIAS CAIXA - FII  | 0,58%              | 0,65%            | Enquadrado    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO                                       | 1,00%              | 0,57%            | Enquadrado    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B                                  | 1,15%              | 0,36%            | Enquadrado    |
| GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | 4,06%              | 1,62%            | Enquadrado    |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | 0,00%              | 0,00%            | Enquadrado    |
| GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES   | 10,14%             | 1,09%            | Enquadrado    |
| LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO        | 14,12%             | 1,05%            | Enquadrado    |
| LME REC IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA   | 5,28%              | 1,09%            | Enquadrado    |
| LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS                       | 2,53%              | 0,50%            | Enquadrado    |
| QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES   | 10,03%             | 2,04%            | Enquadrado    |
| TESOURO IGPM+ 770100 (NTN-C)  | 0,00%              | 7,72%            | Enquadrado    |
| TESOURO IPCA+ 760199 (NTN-B)  | 0,00%              | 10,85%           | Enquadrado    |

|  |        |       |            |
|--|--------|-------|------------|
| TÍTULOS DA DÍVIDA AGRÁRIA (TDA)                                    | 0,00%  | 0,18% | Enquadrado |
| TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA                         | 0,62%  | 0,31% | Enquadrado |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5           | 0,56%  | 0,16% | Enquadrado |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5              | 0,42%  | 0,60% | Enquadrado |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO | 10,33% | 1,69% |            |

\*Não inclui imóveis na proporção por imposição do Artigo 6º, CMN 3922/2010; não inclui disponibilidades financeiras na proporção por conta de padronização junto ao sistema AUDESP/RIRPP.

|  |                    |
|--|--------------------|
| <b>Renda Fixa (Limite de 100%) vs Renda Variável (Limite de 30%)</b> | <b>setembro-17</b> |
| Destinação do Recurso  | Previdência        |

| Tipo               | Valores (R\$)             | Proporção (%)  | Enquadramento |
|--------------------|---------------------------|----------------|---------------|
| Renda Fixa         | R\$ 323.452.035,55        | 81,76%         | Enquadrado    |
| Renda Variável     | R\$ 71.419.387,42         | 18,05%         | Enquadrado    |
| Desenquadrado      | R\$ 728.765,33            | 0,18%          | Desenquadrado |
| <b>Total Geral</b> | <b>R\$ 395.600.188,30</b> | <b>100,00%</b> |               |

\*Não inclui imóveis, ou disp. financeiras.

|  |                    |
|--|--------------------|
| <b>Por Artigo da Resolução CMN 3922/2010</b> | <b>setembro-17</b> |
| Destinação do Recurso                        | Previdência        |

| Artigo da Resolução CMN 3922/2010                                      | Proporção      | Limite Resolução | Enquadramento |
|--|----------------|------------------|---------------|
| Art. 7o, Inciso I, Alinea A - Títulos Públicos                         | 18,57%         | 100,00%          | Enquadrado    |
| Art. 7o, Inciso I, Alinea B - Fundos Exclusivos de Títulos Públicos    | 44,20%         | 100,00%          | Enquadrado    |
| Art. 7o, Inciso III, Alinea A - Fundo de RF ou Referenciado (IMA/IDKA) | 6,50%          | 80,00%           | Enquadrado    |
| Art. 7o, Inciso IV, Alinea A - Fundo de Renda Fixa                     | 11,41%         | 30,00%           | Enquadrado    |
| Art. 7o, Inciso VI - FIDC Cota Senior (Aberto)                         | 0,50%          | 15,00%           | Enquadrado    |
| Art. 7o, Inciso VII, Alinea A - FIDC Cota Senior (Fechado)             | 0,57%          | 5,00%            | Enquadrado    |
| Art. 8o, Inciso III - Fundos de Ações                                  | 10,49%         | 15,00%           | Enquadrado    |
| Art. 8o, Inciso IV - Fundos Multimercado                               | 1,62%          | 5,00%            | Enquadrado    |
| Art. 8o, Inciso V - Fundos de Participação                             | 2,89%          | 5,00%            | Enquadrado    |
| Art. 8o, Inciso VI - Fundos Imobiliários                               | 3,05%          | 5,00%            | Enquadrado    |
| Desenquadrado  | 0,18%          | 0,00%            | Desenquadrado |
| <b>Total Geral</b>   | <b>100,00%</b> | <b>-</b>         |               |

|  |              |               |                   |
|--|--------------|---------------|-------------------|
| <b>Soma dos Artigos VI e VII - (§ 5º, Art. 7º)</b> | <b>1,08%</b> | <b>15,00%</b> | <b>Enquadrado</b> |
|--|--------------|---------------|-------------------|

| Enquadramento FIP Incluindo Provisão para Boletim de Subscrição:   | Total Provisionado | Limite Resolução | Enquadramento Est. |
|--|--------------------|------------------|--------------------|
| FIP BRASIL ÓLEO E GÁS (Provisão de R\$ 1.319.200,00 de 2.000.000,00 - Boletim de Subscrição de 20/06/2012) | 3,23%              | 5,00%            | Enquadrado         |

R\$ 12.773.014,61 → Total FIP + Total Boletim de Subscrição

Por Benchmark  
Destinação do Recurso

setembro-17  
Previdência

|                                     | Proporções de Benchmarks | Proporção [%]  | Total no Benchmark        | Quantidade Ativos |
|-------------------------------------|--------------------------|----------------|---------------------------|-------------------|
| <b>Desenquadrado</b>                |                          |                |                           |                   |
| TR                                  |                          | 0,18%          | R\$ 728.765,33            | 1                 |
| <b>Disponibilidades Financeiras</b> |                          |                |                           |                   |
| N/A                                 |                          | 0,09%          | R\$ 343.488,10            | 6                 |
| <b>Renda Fixa</b>                   |                          |                |                           |                   |
| ATUARIAL                            |                          | 1,07%          | R\$ 4.254.538,03          | 5                 |
| DI                                  |                          | 11,40%         | R\$ 45.138.215,87         | 1                 |
| IDKA IPCA 2A                        |                          | 11,08%         | R\$ 43.873.169,83         | 1                 |
| IGPM                                |                          | 7,71%          | R\$ 30.541.794,80         | 1                 |
| IMA-B                               |                          | 14,42%         | R\$ 57.110.258,64         | 7                 |
| IMA-B 5                             |                          | 0,76%          | R\$ 3.016.308,44          | 2                 |
| IPCA                                |                          | 10,84%         | R\$ 42.936.403,11         | 1                 |
| IRF-M                               |                          | 5,80%          | R\$ 22.961.321,91         | 1                 |
| IRF-M 1                             |                          | 18,59%         | R\$ 73.620.024,92         | 1                 |
| <b>Renda Variável</b>               |                          |                |                           |                   |
| ATUARIAL                            |                          | 4,51%          | R\$ 17.862.510,55         | 5                 |
| IBOVESPA                            |                          | 6,35%          | R\$ 25.127.240,85         | 6                 |
| IBRX                                |                          | 2,04%          | R\$ 8.064.253,12          | 1                 |
| IDIV                                |                          | 0,69%          | R\$ 2.719.600,12          | 1                 |
| IMOBILIARIO                         |                          | 3,05%          | R\$ 12.070.705,10         | 4                 |
| SMLL                                |                          | 0,68%          | R\$ 2.710.393,63          | 1                 |
| ICON                                |                          | 0,72%          | R\$ 2.864.684,05          | 1                 |
| <b>Total Geral</b>                  |                          | <b>100,00%</b> | <b>R\$ 395.943.676,40</b> | <b>46</b>         |

## Credenciamento

Estes dados trazem os prestadores de serviços dos fundos do Hortoprev versus a situação de seus processos de credenciamento - em parênteses, os vencimentos dos credenciamentos ativos.

Em **ROXO**: Credenciamentos inexistentes, indeferidos ou desatualizados. / Em **PRETO**: Credenciamentos vigentes. / Em **VERMELHO**: Resgates já solicitados ou em desinvestimento, aguardando liquidação.

| Fundo  | Administrador  | Gestor  |
|--|--|---|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI (21/03/18)                            | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A. (21/03/18)                 | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A. (21/03/18)              |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI (21/03/18)                       | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A. (21/03/18)                 | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A. (21/03/18)              |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO (21/03/18)                          | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A. (21/03/18)                 | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A. (21/03/18)              |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A. (21/03/18)                 | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A. (21/03/18)              |
| BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO                    | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A. (21/03/18)                 | BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A. (21/03/18)              |
| BNP PARIBAS ACTION FICFIA (04/09/18)   | BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT BRASIL LTDA (04/09/18)        | BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A. (04/09/18)                |
| QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA. | QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA              |
| FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES                                 | BEM - DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA. | VALORA GESTÃO DE INVESTIMENTOS LTDA.                    |
| AZ QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES (20/09/2018)                               | BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.                  | AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA. (20/09/2018)               |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FI DE AÇÕES (20/09/2018)   | BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.                  | AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA. (20/09/2018)               |
| BRZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES                  | BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.                  | BRZ INVESTIMENTOS LTDA                                  |
| ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÃO               | BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.                  | ÁTICO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA                    |
| ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP   | BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.                  | ÁTICO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA                    |
| GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES   | BRB DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A.    | G F GESTÃO DE RECURSOS S/A                              |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5                                     | BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA                     | BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA                  |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5  | BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA                     | BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA                  |
| LME CREDITO PRIVADO REC FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA                                     | BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA                     | BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA                  |
| TMJ IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA   | BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA.                    | TMJ CAPITAL GESTAO DE RECURSOS LTDA                     |
| FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND                    | BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A. DTVM                 | BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A. DTVM              |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                       | CAIXA ECONOMICA FEDERAL (09/01/2018)                       | CAIXA ECONOMICA FEDERAL (09/01/2018)                    |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP (09/01/18)                       | CAIXA ECONOMICA FEDERAL (09/01/2018)                       | CAIXA ECONOMICA FEDERAL (09/01/2018)                    |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO (09/01/18)                     | CAIXA ECONOMICA FEDERAL (09/01/2018)                       | CAIXA ECONOMICA FEDERAL (09/01/2018)                    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR                | CAIXA ECONOMICA FEDERAL (09/01/2018)                       | VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA                 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM                                 | FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.    | FINAXIS CORRETORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5                           | FOCO DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.  | GENUS CAPITAL GROUP GESTAO DE RECURSOS LTDA             |
| AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO  | FOCO DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.  | AQUILLA ASSET   |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES                                     | GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S/A                    | G F GESTÃO DE RECURSOS S/A                              |
| GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S/A                    | G F GESTÃO DE RECURSOS S/A                              |
| LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                                | GRADUAL CCTVM S.A.   | BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA                  |
| LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITARIOS                     | GRADUAL CCTVM S.A.   | BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA                  |
| FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2  | GRADUAL CCTVM S.A.   | BRASIL PLURAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA                   |
| FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3  | GRADUAL CCTVM S.A.   | BRASIL PLURAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA                   |
| FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4  | GRADUAL CCTVM S.A.   | BRASIL PLURAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA                   |
| FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO                                  | GRADUAL CCTVM S.A.   | FMD GESTÃO DE RECURSOS LTDA.                            |
| LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CR                | GRADUAL CCTVM S.A.   | BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA                  |
| BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA  | ORLA DTVM S.A.   | INTERATIVA INVESTIMENTOS LTDA.                          |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO                           | PLANNER CORRETORA DE VALORES S.A.                          | QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA              |
| FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII                                       | RIO BRAVO INVESTIMENTOS DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES | RIO BRAVO INVESTIMENTOS DTVM                            |



16/10/2017

**ANTONIO AGNELO BONADIO**

*Diretor Superintendente*

*superintendencia@hortoprev.hortolandia.sp.gov.br*

**AGNALDO MESSIAS RODRIGUES**

*Diretor Financeiro*

*dfinanceiro@hortoprev.hortolandia.sp.gov.br*

**LEONARDO D. A. FACCHINI**

*Economista*

*investimentos@hortoprev.hortolandia.sp.gov.br*

**ALCIR FURTADO PESSE**

*Comitê de Investimentos*

*dbeneficio@hortoprev.hortolandia.sp.gov.br*

**TATIANA TIEMI TOKU DE ARAUJO**

*Comitê de Investimentos*

*financeiro@hortoprev.hortolandia.sp.gov.br*

**THAIS SANTOS FEITOZA**

*Comitê de Investimentos*

*protocolo@hortoprev.hortolandia.sp.gov.br*

**ANDRESSA DE LIMA**

*Comitê de Investimentos*

*assessoria2@hortoprev.hortolandia.sp.gov.br*

Disclaimer

Este é um relatório gerencial do Hortoprev a fim de trazer publicidade a todos os segurados e pensionistas da autarquia conforme preza Portaria MPS 519/11. Os dados aqui apresentados são resultados de automação de sistema e podem conter erros de digitação da base de dados, arredondamento de sistema, erro humano, etc. Desta maneira, o Hortoprev se resguarda sob qualquer informação prestada de maneira equivocada, corrigindo-a caso comprovado equivoco, fazendo saber que todos os documentos e lastros documentais que geraram este relatório estão a disposição dos segurados e pensionistas para visualização, mediante orientação da Diretoria Executiva desta Autarquia.