

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2010

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.019.123.237,72		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			720.717.496,03	70,72	
<u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL</u>					
<u>Nota do Tesouro Nacional</u>		131.192	262.772.042,03	25,78	
<u>Letras Financeiras Tesouro</u>		10	10.531,09	0,00	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			244.804.317,93	24,02	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		154	147.345.654,57	14,46	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	5	30.043.506,88	2,95	2,95
. CDB 365 DIAS - BANIF	PÓS	1	7.401.908,05	0,73	0,73
. CDB 942 DIAS - BBM	PÓS	1	2.516.798,08	0,25	
. CDB 1170 DIAS - BBM	PÓS	1	6.657.983,47	0,65	0,90
. CDB 180 DIAS - BICBANCO	PÓS	15	4.880.586,39	0,48	
. CDB 181 DIAS - BICBANCO	PÓS	2	178.283,78	0,02	
. CDB 182 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	181.348,67	0,02	
. CDB 184 DIAS - BICBANCO	PÓS	2	2.647.865,65	0,26	0,77
. CDB 180 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	5	407.105,72	0,04	
. CDB 181 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	2	180.219,55	0,02	
. CDB 182 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	2	170.161,98	0,02	
. CDB 183 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	2	1.734.716,48	0,17	
. CDB 184 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	2	715.901,33	0,07	0,31
. CDB 180 DIAS - BVA	PÓS	24	11.488.926,42	1,13	
. CDB 181 DIAS - BVA	PÓS	10	613.988,27	0,06	
. CDB 182 DIAS - BVA	PÓS	18	1.280.303,73	0,13	
. CDB 183 DIAS - BVA	PÓS	5	189.150,35	0,02	
. CDB 184 DIAS - BVA	PÓS	2	2.637.970,95	0,26	
. CDB 362 DIAS - BVA	PÓS	1	154.394,09	0,02	1,61
. CDB 182 DIAS - CACIQUE	PÓS	2	37.977,89	0,00	0,00
. CDB 183 DIAS - INDUSVAL	PÓS	2	2.132.848,78	0,21	0,21
. CDB 569 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	2.483.011,29	0,24	
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	2	12.266.474,59	1,20	
. CDB 1856 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	6.071.101,70	0,60	2,04
. CDB 180 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	11	9.511.362,98	0,93	
. CDB 181 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	167.069,06	0,02	
. CDB 182 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	7	4.944.214,21	0,49	
. CDB 184 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	1.145.054,68	0,11	1,55
. CDB 180 DIAS - PINE	PÓS	1	101.500,61	0,01	
. CDB 181 DIAS - PINE	PÓS	1	55.853,40	0,01	
. CDB 182 DIAS - PINE	PÓS	2	178.801,06	0,02	
. CDB 184 DIAS - PINE	PÓS	4	715.687,33	0,07	0,10
. CDB 3536 DIAS - PROSPER	PÓS	1	5.639.377,11	0,55	
. CDB 3652 DIAS - PROSPER	PÓS	1	5.638.987,18	0,55	1,11
. CDB 180 DIAS - SCHAHIN	PÓS	3	2.245.165,17	0,22	
. CDB 182 DIAS - SCHAHIN	PÓS	3	1.232.070,02	0,12	
. CDB 184 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	1.545.900,54	0,15	
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	5.554.994,78	0,55	1,04
. CDB 180 DIAS - SOFISA	PÓS	1	101.500,61	0,01	
. CDB 182 DIAS - SOFISA	PÓS	1	2.506.945,30	0,25	
. CDB 183 DIAS - SOFISA	PÓS	1	208.808,10	0,02	
. CDB 184 DIAS - SOFISA	PÓS	2	715.944,16	0,07	0,35
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	2	8.063.884,18	0,79	0,79

Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		35.172.202,40	97.458.663,36	9,56	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	38.615,71	0,00	0,00
. BRADESCO DI FIF ASSISTENCIAL		11.370.824,14	35.560.733,93	3,49	3,49
. REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		11,56	8.585,37	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		3.209.381,40	4.075.537,93	0,40	0,40
. MULTIMERCADO		20.575.203,06	43.451.766,89	4,26	4,26
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		125,00	126.566,25	0,01	0,01
. FIDC PAULISTA		3.000,00	999.642,43	0,10	0,10
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		4.467,00	4.330.149,35	0,42	0,42
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.674,00	8.867.065,50	0,87	0,87
Debêntures		15.497	30.483.702,27	2,99	
. CPFL ENERGIA		1.101	10.983.644,77	1,08	1,08
. ELETROMETRÔ		10.248	7.973.269,34	0,78	0,78
. PETROBRÁS		3.760	7.607.480,78	0,75	0,75
. VALE DO RIO DOCE		388	3.919.307,38	0,38	0,38
Outros Títulos		5.075	182.646.902,71	17,92	
. Certificado de Recebíveis Imobiliários		52	18.841.828,75	1,85	1,85
. Cédula de Crédito Bancário		20	44.739.295,14	4,39	4,39
. Certificado de Cédula de Créd. Bancário		3	113.163.404,01	11,10	11,10
. Depósito a Prazo com Garantia Especial		5.000	5.902.374,81	0,58	0,58
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			161.609.381,96	15,85	
B1. Mercado de Ações			79.424.004,49	7,79	
Companhias Abertas		4.059.879	67.049.755,21	6,58	
. ALL AMER LAT	UNT	61.078	867.307,60	0,09	
. AMBEV	DIR	99	17.811,09	0,00	
. AMBEV	PN	13.329	2.398.020,39	0,24	
. BRADESPAR	PN	17.700	580.383,00	0,06	
. BRASIL ECODEISEL	ON	337.500	283.500,00	0,03	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	101.650	2.409.105,00	0,24	
. BR MALLS PAR	ON	17.200	404.200,00	0,04	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	283.600	3.289.760,00	0,32	
. CEMIG	PN	34.785	909.975,60	0,09	
. CESP	PNB	31.800	782.280,00	0,08	
. CONFAB	PN	58.423	284.520,01	0,03	
. COPEL	PNB	26.370	980.964,00	0,10	
. DURATEX	ON	14.200	232.880,00	0,02	
. ECOROVIAS	ON	36.700	366.266,00	0,04	
. ELETROBRÁS	ON	50.677	1.209.153,22	0,12	
. GERDAU - GGBR	PN	45.578	1.075.185,02	0,11	
. HYPERMARCAS	ON	28.300	655.994,00	0,06	
. ITAUSA	DIR	1.851	19.824,21	0,00	
. ITAUSA	PN	233.038	2.495.836,98	0,24	
. LOJAS AMERICANAS	PN	33.600	439.488,00	0,04	
. MARFRIG	ON	46.500	784.920,00	0,08	
. MILLS	ON	13.400	182.910,00	0,02	
. NATURA	ON	20.800	832.000,00	0,08	
. NETC - NET	PN	54.545	927.265,00	0,09	
. OHL BRASIL	ON	10.800	452.412,00	0,04	
. PÃO DE AÇUCAR	PNA	23.581	1.485.131,38	0,15	
. PDG REALT	ON	99.717	1.519.687,08	0,15	
. PETROBRÁS	ON	189.807	5.884.017,00	0,58	
. PETROBRÁS	PN	295.104	7.926.493,44	0,78	
. POSITIVO INF	ON	20.900	354.673,00	0,03	
. RANDON PART	PN	44.350	456.361,50	0,04	
. REDECARD - RDCD	ON	32.200	821.100,00	0,08	
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	91.242	2.399.664,60	0,24	
. SUZANO PAPEL	PNA	27.950	425.119,50	0,04	
. TAPE	ON	1.300.000	8.723.000,00	0,86	
. TELEMAR - TNLP	PN	36.591	987.957,00	0,10	
. TRECTEBEL	ON	27.200	576.368,00	0,06	
. USIMINAS	PNA	15.162	729.443,82	0,07	
. VALE R. DOCE	ON	80.963	3.534.034,95	0,35	
. VALE R. DOCE	PNA	171.960	6.519.003,60	0,64	
. VIVO - VIVO4	PN	29.629	1.374.785,60	0,13	
. CONTAS A RECEBER			3.184,62	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			447.769,00	0,04	

Instituições Financeiras		418.208	12.374.249,28	1,21
. BRADESCO	PN	146.490	4.117.833,90	0,40
. BRASIL	PN	78.752	1.941.236,80	0,19
. ITAÚ	PN	192.966	6.271.395,00	0,62
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			43.783,58	0,00
B2. Mercado de Opções		85.000	-22.540,15	0,00
. VALE	PNA	85.000	-22.540,15	0,00
B3. Fundos		10.130.873,82	82.207.917,62	8,07
. SCHRODERS FIA EXCLUSIVO		562.255,35	55.333.907,31	5,43
. FATOR SINERGIA		8.342,00	9.607.915,68	0,94
. GERAÇÃO FUTURO		8.934.666,77	14.420.808,60	1,42
. RB FUNDAMENTAL		625.609,70	2.845.286,03	0,28
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		65.865,29	17.843.059,03	1,76
. GOVERNANÇA E GESTÃO		10.354,55	4.661.543,27	0,46
. GOVERNANÇA E GESTÃO II		5.986,08	5.545.200,15	0,54
. FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES		524,66	2.540.807,41	0,25
. MEMORIAL OFFICE		10.000	986.684,02	0,10
. ÁGUA BRANCA		39.000	4.032.624,18	0,40
. Valores a receber			76.200,00	0,01
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			52.504.665,02	5,15
D1 - Investimentos em Shopping Center			41.000.259,49	4,02
Shopping Tatuapé II			11.797.739,36	1,16
Shopping Plaza Sul			20.874.423,15	2,05
Shopping Metrô Itaquera			7.851.596,59	0,77
. Valores a receber			476.500,39	0,05
D2 - Investimento Imobiliário			11.504.405,53	1,13
. PANAMBY			12.441.286,84	1,22
. Valores a pagar (-)			-936.881,31	-0,09
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		4.075	57.248.192,83	5,62
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		4.075	56.895.555,62	5,58
. VALORES A PAGAR (-)			-40.785,72	0,00
. VALORES A RECEBER			393.422,93	0,04
F - OUTROS			9.200.442,85	0,90
. Disponíveis			7.326.699,50	0,72
. Outros realizáveis/exigibilidades			1.873.743,35	0,18

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- SCHRODERS FIA EXCLUSIVO	55.333.907,31	30,90%	5,43%
FUNDOS			
- MULTIMERCADO	43.451.766,89	24,27%	4,26%
- FUNDO FATOR SINERGIA	9.607.915,68	5,36%	0,94%
- GERAÇÃO FUTURO	14.420.808,60	8,05%	1,42%
- RB.FUNDAMENTAL	2.845.286,03	1,59%	0,28%
FUNDO EXCLUSIVO			
- METRUS DI FIF BRAM - ASSISTENCIAL	35.560.733,93	19,86%	3,49%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO	4.661.543,27	2,60%	0,46%
- GOVERNANÇA E GESTÃO II	5.545.200,15	3,10%	0,54%
- FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES	2.540.807,41	1,42%	0,25%
- MEMORIAL OFFICE	996.584,02	0,56%	0,10%
- ÁGUA BRANCA	4.098.924,18	2,29%	0,40%
TOTAL	179.063.477,47	100,00%	17,57%

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	641.704.995,21	76,39%	62,97%
RENTA VARIÁVEL	79.401.464,34	9,45%	7,79%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	52.504.665,02	6,25%	5,15%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	57.248.192,83	6,81%	5,62%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	9.200.442,85	1,10%	0,90%
TOTAL	840.059.760,25	100,00%	82,43%