

RESUMO DO DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - D I

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2010

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
RECURSOS GARANTIDORES DAS RESERVAS TÉCNICAS			663.452.540,08		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			481.320.464,61	72,55	
<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>		105.029	245.569.906,82	37,01	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			<u>94.736.357,77</u>	<u>14,28</u>	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		<u>59</u>	<u>57.282.654,02</u>	<u>8,63</u>	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	1	5.941.010,14	0,90	0,90
. CDB 180 DIAS - BVA	PÓS	10	6.763.275,45	1,02	
. CDB 181 DIAS - BVA	PÓS	5	449.332,33	0,07	
. CDB 182 DIAS - BVA	PÓS	8	833.068,62	0,13	
. CDB 183 DIAS - BVA	PÓS	2	58.558,98	0,01	
. CDB 184 DIAS - BVA	PÓS	1	1.031.263,08	0,16	
. CDB 362 DIAS - BVA	PÓS	1	154.394,09	0,02	1,40
. CDB 180 DIAS - BICBANCO	PÓS	6	1.532.740,89	0,23	
. CDB 182 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	181.348,67	0,03	
. CDB 184 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	842.081,06	0,13	0,39
. CDB 180 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	186.220,89	0,03	
. CDB 181 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	174.144,73	0,03	
. CDB 182 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	11.141,56	0,00	
. CDB 183 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	1.525.983,07	0,23	0,29
. CDB 183 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	1.924.222,55	0,29	0,29
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	8.586.405,37	1,29	1,29
. CDB 180 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	4	6.198.999,84	0,93	
. CDB 182 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3	1.799.784,79	0,27	
. CDB 184 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	1.145.054,68	0,17	1,38
. CDB 181 DIAS - PINE	PÓS	1	55.853,40	0,01	
. CDB 182 DIAS - PINE	PÓS	1	124.957,56	0,02	
. CDB 184 DIAS - PINE	PÓS	1	45.747,11	0,01	0,03
. CDB 3536 DIAS - PROSPER	PÓS	1	5.639.377,11	0,85	0,85
. CDB 180 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	1.304.317,90	0,20	
. CDB 184 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	1.545.900,54	0,23	0,43
. CDB 182 DIAS - SOFISA	PÓS	1	2.506.945,30	0,38	
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	6.720.524,31	1,01	1,01
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		<u>13.444.904,56</u>	<u>37.453.703,75</u>	<u>5,65</u>	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	38.615,71	0,01	0,01
. MULTIMERCADO		13.434.207,32	28.568.950,50	4,31	4,31
. FIDC PAULISTA		2.000,00	666.428,28	0,10	0,10
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		3.467,00	3.360.785,26	0,51	0,51
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.714,00	4.818.924,00	0,73	0,73
<u>Debêntures</u>		<u>12.122</u>	<u>25.089.237,88</u>	<u>3,78</u>	
. CPFL ENERGIA		800	7.980.849,97	1,20	1,20
. ELETROMETRÔ		7.174	5.581.599,75	0,84	0,84
. PETROBRÁS		3.760	7.607.480,78	1,15	1,15
. VALE DO RIO DOCE		388	3.919.307,38	0,59	0,59
<u>Outros Títulos</u>		<u>52</u>	<u>115.924.962,14</u>	<u>17,47</u>	
. Certificado de Recebíveis Imobiliários		34	13.756.537,37	2,07	2,07
. Cédula de Crédito Bancário		17	33.582.513,44	5,06	5,06

. Certificado de Cédula de Créd. Bancário		1	68.585.911,33	10,34	10,34
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			93.265.630,26	14,05	
B1. Mercado de Ações			44.654.655,87	6,73	
Companhias Abertas		2.702.508	38.371.293,66	5,78	
. ALL AMER LAT	UNT	31.066	441.137,20	0,07	
. AMBEV	DIR	51	9.175,41	0,00	
. AMBEV	PN	6.768	1.217.630,88	0,18	
. BRADESCO	PN	9.000	295.110,00	0,04	
. BRASIL ECODESEL	ON	171.400	143.976,00	0,02	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	51.624	1.223.488,80	0,18	
. BR MALLS PAR	ON	8.700	204.450,00	0,03	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	142.900	1.657.640,00	0,25	
. CEMIG	PN	17.645	461.593,20	0,07	
. CESP	PNB	16.200	398.520,00	0,06	
. CONFAB	PN	29.520	143.762,40	0,02	
. COPEL	PNB	13.273	493.755,60	0,07	
. DURATEX	ON	7.200	118.080,00	0,02	
. ECOROVAS	ON	19.200	191.616,00	0,03	
. ELETROBRÁS	ON	25.788	615.301,68	0,09	
. GERDAU - GGBR	PN	23.164	546.438,76	0,08	
. HYPERMARCAS	ON	14.400	333.792,00	0,05	
. ITAUSA	DIR	938	10.045,98	0,00	
. ITAUSA	PN	118.246	1.266.414,66	0,19	
. LOJAS AMERICANAS	PN	17.100	223.668,00	0,03	
. MARFRIG	ON	23.800	401.744,00	0,06	
. MILLS	ON	6.800	92.820,00	0,01	
. NATURA	ON	10.600	424.000,00	0,06	
. NETC - NET	PN	27.698	470.866,00	0,07	
. OHL BRASIL	ON	5.500	230.395,00	0,03	
. PÃO DE AÇUCAR	PNA	12.009	756.326,82	0,11	
. PDG REALT	ON	50.946	776.417,04	0,12	
. PETROBRÁS	ON	96.328	2.986.168,00	0,45	
. PETROBRÁS	PN	150.184	4.033.942,24	0,61	
. POSITIVO INF	ON	10.600	179.882,00	0,03	
. RANDON PART	PN	23.200	238.728,00	0,04	
. REDECARD - RDCD	ON	16.300	415.650,00	0,06	
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	46.708	1.228.420,40	0,19	
. SUZANO PAPEL	PNA	14.100	214.461,00	0,03	
. TAIPÉ	ON	1.300.000	8.723.000,00	1,31	
. TELEMAR - TNLP	PN	18.563	501.201,00	0,08	
. TRECTEBEL	ON	13.800	292.422,00	0,04	
. USIMINAS	PNA	7.729	371.842,19	0,06	
. VALE R. DOCE	ON	41.056	1.792.094,40	0,27	
. VALE R. DOCE	PNA	87.327	3.310.566,57	0,50	
. VIVO - VIVO4	PN	15.077	699.572,80	0,11	
. CONTAS A RECEBER			2.318,89	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			232.858,74	0,04	
Instituições Financeiras		212.361,00	6.283.362,21	0,94	
. BRADESCO	PN	74.325	2.089.275,75	0,31	
. BRASIL	PN	40.047	987.158,55	0,15	
. ITAÚ	PN	97.989	3.184.642,50	0,48	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			22.285,41	0,00	
B2. Mercado de Opções		29.000	-7.600,91	0,00	
. VALE	PNA	29.000	-7.600,91	0,00	
B3. Fundos		3.993.096	48.618.575,30	7,33	
. SCHROEDERS FIA EXCLUSIVO		385.470	37.935.753,70	5,72	
. FATOR SINERGIA		3.202	3.687.910,09	0,56	
. GERAÇÃO FUTURO		3.203.173	5.170.013,08	0,78	
. RB FUNDAMENTAL		401.251	1.824.898,43	0,28	

C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		6.386,86	7.486.094,70	1,13
. GOVERNANÇA E GESTÃO II		5.986	5.545.200,15	0,84
. FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES		400,78	1.940.894,55	0,29
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			44.653.068,43	6,73
D1 - Investimentos em Shopping Center			33.148.662,90	5,00
Shopping Tatuapé II			11.797.739,36	1,78
Shopping Plaza Sul			20.874.423,15	3,15
. Valores a receber			476.500,39	0,07
D2 - Investimento Imobiliário			11.504.405,53	1,73
. PANAMBY			12.441.286,84	1,88
. Valores a pagar (-)			-936.881,31	-0,14
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.320	31.102.357,72	4,69
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.320	30.905.157,56	4,66
. VALORES A PAGAR (-)			-20.228,42	0,00
. VALORES A RECEBER			217.428,58	0,03
F - OUTROS			5.624.924,36	0,85
. Disponíveis			3.622.564,27	0,55
. Outros realizáveis/exigibilidades			2.002.360,09	0,30

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- SCHRODERS FIA EXCLUSIVO	37.935.753,70	44,80%	5,72%
FUNDOS			
- MULTIMERCADO	28.568.950,50	33,74%	4,31%
- FUNDO FATOR SINERGIA	3.687.910,09	4,36%	0,56%
- GERAÇÃO FUTURO	5.170.013,08	6,11%	0,78%
- RB.FUNDAMENTAL	1.824.898,43	2,16%	0,28%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO II	5.545.200,15	6,55%	0,84%
- FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES	1.940.894,55	2,29%	0,29%
TOTAL	84.673.620,50	100,00%	12,76%

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	452.751.514,11	78,23%	68,24%
RENDA VARIÁVEL	44.647.054,96	7,71%	6,73%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	44.653.068,43	7,72%	6,73%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	31.102.357,72	5,37%	4,69%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	5.624.924,36	0,97%	0,85%
TOTAL	578.778.919,58	100,00%	87,24%