

RESUMO DO DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - D I

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2010

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
RECURSOS GARANTIDORES DAS RESERVAS TÉCNICAS			249.485.377,79		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			143.972.151,15	57,71	
<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>		10.069	15.908.239,83	6,38	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			88.280.445,27	35,39	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		66	71.381.656,98	28,61	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	2	12.048.760,81	4,83	4,83
. CDB 365 DIAS - BANIF	PÓS	1	7.401.908,05	2,97	2,97
. CDB 942 DIAS - BBM	PÓS	1	2.516.798,08	1,01	
. CDB 1170 DIAS - BBM	PÓS	1	6.657.983,47	2,67	3,68
. CDB 180 DIAS - BICBANCO	PÓS	6	1.877.077,09	0,75	
. CDB 181 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	37.922,15	0,02	
. CDB 184 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	1.805.784,59	0,72	1,49
. CDB 180 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	16.193,12	0,01	
. CDB 181 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	6.074,82	0,00	
. CDB 182 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	159.020,42	0,06	
. CDB 183 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	208.733,41	0,08	
. CDB 184 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	293.949,06	0,12	0,27
. CDB 180 DIAS - BVA	PÓS	11	3.634.785,98	1,46	
. CDB 181 DIAS - BVA	PÓS	5	164.655,94	0,07	
. CDB 182 DIAS - BVA	PÓS	6	320.753,86	0,13	
. CDB 183 DIAS - BVA	PÓS	2	124.492,38	0,05	
. CDB 184 DIAS - BVA	PÓS	1	1.606.707,87	0,64	2,35
. CDB 183 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	208.626,23	0,08	0,08
. CDB 569 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	2.483.011,29	1,00	
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	3.680.069,22	1,48	
. CDB 1856 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	6.071.101,70	2,43	4,90
. CDB 180 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	5	2.683.578,51	1,08	
. CDB 181 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	167.069,06	0,07	
. CDB 182 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	3	2.607.942,09	1,05	2,19
. CDB 182 DIAS - PINE	PÓS	1	53.843,50	0,02	
. CDB 184 DIAS - PINE	PÓS	2	293.798,11	0,12	0,14
. CDB 3652 DIAS - PROSPER	PÓS	1	5.638.987,18	2,26	2,26
. CDB 180 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	940.847,27	0,38	
. CDB 182 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	269.963,94	0,11	
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	5.554.994,78	2,23	2,71
. CDB 183 DIAS - SOFISA	PÓS	1	208.808,10	0,08	
. CDB 184 DIAS - SOFISA	PÓS	1	294.055,03	0,12	0,20
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	1.343.359,87	0,54	0,54
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		6.521.187,74	16.898.788,29	6,77	
. MULTIMERCADO		6.517.587,74	13.908.919,45	5,58	5,58
. FIDC PAULISTA		1.000,00	333.214,15	0,13	0,13
. FIDC MULTISETORIAL BVA MASTER		2.475,00	2.530.088,44	1,01	1,01
. BRZ MULTI RECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		125,00	126.566,25	0,05	0,05

Debêntures		3.375	5.394.464,39	2,16	
. CPFL ENERGIA		301	3.002.794,80	1,20	1,20
. ELETROMETRÔ		3.074	2.391.669,59	0,96	0,96
Outros Títulos		3.021	34.389.001,66	13,78	
. Certificado de Recebíveis Imobiliários		18	5.085.291,38	2,04	2,04
. Cédula de Crédito Bancário		2	5.758.081,39	2,31	2,31
. Cédula de Crédito Imobiliário				0,00	0,00
. Certificado de Cédula de Créd. Bancário		1	20.004.224,14	8,02	8,02
. Depósito a Prazo com Garantia Especial		3.000	3.541.404,75	1,42	1,42
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			58.220.623,61	23,33	
B1. Mercado de Ações			33.270.689,17	13,33	
Companhias Abertas		1.297.756	27.445.089,48	11,00	
. ALL AMER LAT	UNT	28.785	408.747,00	0,16	
. AMBEV	DIR	47	8.455,77	0,00	
. AMBEV	PN	6.309	1.135.052,19	0,45	
. BRADESCAR	PN	8.300	272.157,00	0,11	
. BRASIL ECODIESEL	ON	158.800	133.392,00	0,05	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	47.854	1.134.139,80	0,45	
. BR MALLS PAR	ON	8.100	190.350,00	0,08	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	134.400	1.559.040,00	0,62	
. CEMIG	PN	16.385	428.631,60	0,17	
. CESP	PNB	15.000	369.000,00	0,15	
. CONFAB	PN	27.256	132.736,72	0,05	
. COPEL	PNB	12.452	463.214,40	0,19	
. DURATEX	ON	6.600	108.240,00	0,04	
. ECOMOVIAS	ON	16.700	166.666,00	0,07	
. ELETROBRÁS	ON	23.849	569.037,14	0,23	
. GERDAU - GGBR	PN	21.424	505.392,16	0,20	
. HYPERMARCAS	ON	13.300	308.294,00	0,12	
. ITAUSA	DIR	879	9.414,09	0,00	
. ITAUSA	PN	109.716	1.175.058,36	0,47	
. LOJAS AMERICANAS	PN	15.800	206.664,00	0,08	
. MARFRIG	ON	21.900	369.672,00	0,15	
. MILLS	ON	6.100	83.265,00	0,03	
. NATURA	ON	9.800	392.000,00	0,16	
. NETC - NET	PN	25.676	436.492,00	0,17	
. OHL BRASIL	ON	5.100	213.639,00	0,09	
. PÃO DE AÇUCAR	PNA	11.067	696.999,66	0,28	
. PDG REALT	ON	46.627	710.595,48	0,28	
. PETROBRÁS	ON	89.512	2.774.872,00	1,11	
. PETROBRÁS	PN	138.546	3.721.345,56	1,49	
. POSITIVO INF	ON	9.900	168.003,00	0,07	
. RANDON PART	PN	20.200	207.858,00	0,08	
. REDECARD - RDCD	ON	15.100	385.050,00	0,15	
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	42.638	1.121.379,40	0,45	
. SUZANO PAPEL	PNA	13.175	200.391,75	0,08	
. TELEMAR - TNLP	PN	17.242	465.534,00	0,19	
. TRECTEBEL	ON	12.800	271.232,00	0,11	
. USIMINAS	PNA	7.143	343.649,73	0,14	
. VALE R. DOCE	ON	38.228	1.668.652,20	0,67	
. VALE R. DOCE	PNA	81.117	3.075.145,47	1,23	
. VIVO - VIVO4	PN	13.929	646.305,60	0,26	
. CONTAS A RECEBER			865,73	0,00	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			208.459,67	0,08	
Instituições Financeiras		196.879,00	5.825.599,69	2,33	
. BRADESCO	PN	68.990	1.939.308,90	0,78	
. BRASIL	PN	37.026	912.690,90	0,37	
. ITAÚ	PN	90.863	2.953.047,50	1,18	

. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			20.552,39	0,01
B2. Mercado de Opções		<u>28.000</u>	<u>-7.735,50</u>	<u>0,00</u>
. VALE	PNA	28.000	-7.735,50	0,00
B3. Fundos		<u>3.034.053</u>	<u>24.957.669,94</u>	<u>10,00</u>
. SCHRODERS FIA EXCLUSIVO		176.785	17.398.153,61	6,97
. FATOR SINERGIA		2.563	2.951.940,53	1,18
. GERAÇÃO FUTURO		2.854.705	4.607.575,80	1,85
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		59.478,43	10.356.964,33	4,15
. GOVERNANÇA E GESTÃO		10.355	4.661.543,27	1,87
. FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES		123,88	599.912,86	0,24
. FUNDO IMOBILIÁRIO MEMORIAL OFFICE		10.000	986.684,02	0,40
. FUNDO IMOBILIÁRIO ÁGUA BRANCA		39.000	4.032.624,18	1,62
. Valores a receber			76.200,00	0,03
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			7.851.596,59	3,15
D1 - Investimentos em Shopping Center			<u>7.851.596,59</u>	<u>3,15</u>
Shopping Metrô Itaquera			7.851.596,59	3,15
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		1.755	26.145.835,11	10,48
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		1.755	25.990.398,06	10,42
. VALORES A PAGAR (-)			-20.557,30	-0,01
. VALORES A RECEBER			175.994,35	0,07
F - OUTROS			2.938.207,00	1,18
. Disponíveis			2.634.994,20	1,06
. Outros realizáveis/exigibilidades			303.212,80	0,12

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- SCHRODERS FIA EXCLUSIVO	17.398.153,61	35,35%	6,97%
FUNDOS			
- MULTIMERCADO	13.908.919,45	28,25%	5,58%
- FUNDO FATOR SINERGIA	2.951.940,53	6,00%	1,18%
- GERAÇÃO FUTURO	4.607.575,80	9,36%	1,85%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO	4.661.543,27	9,47%	1,87%
- FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES	599.912,86	1,22%	0,24%
- FUNDO IMOBILIÁRIO MEMORIAL OFFICE	996.584,02	2,02%	0,40%
- FUNDO IMOBILIÁRIO ÁGUA BRANCA	4.098.924,18	8,33%	1,64%
TOTAL	49.223.553,72	100,00%	19,73%

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	130.063.231,70	63,59%	52,13%
RENDA VARIÁVEL	33.262.953,67	18,61%	13,33%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	7.851.596,59	3,11%	3,15%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	26.145.835,11	14,39%	10,48%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	2.938.207,00	0,30%	1,18%
TOTAL	200.261.824,07	100,00%	80,27%