

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2011

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.168.001.347,93		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			808.183.825,31	69,19	
<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>		141.653	301.302.882,48	25,80	
<u>Letras Financeiras Tesouro</u>		10	47.337,95	0,00	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			272.621.711,94	23,34	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		113	184.540.338,01	15,80	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	5	36.139.633,46	3,09	3,09
. CDB 365 DIAS - BANIF	PÓS	3	8.547.443,68	0,73	0,73
. CDB 942 DIAS - BBM	PÓS	1	3.031.795,14	0,26	
. CDB 1170 DIAS - BBM	PÓS	1	7.961.245,46	0,68	0,94
. CDB 234 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	214.847,08	0,02	
. CDB 248 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	268.579,95	0,02	
. CDB 257 DIAS - BICBANCO	PÓS	2	3.118.339,94	0,27	
. CDB 262 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	214.880,99	0,02	
. CDB 276 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	107.449,02	0,01	
. CDB 297 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	161.191,59	0,01	
. CDB 304 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	214.930,76	0,02	
. CDB 311 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	200.968,33	0,02	
. CDB 315 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	1.145.064,43	0,10	
. CDB 1827 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	708.027,84	0,06	0,54
. CDB 181 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	946.462,49	0,08	
. CDB 227 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	2	2.694.619,80	0,23	
. CDB 381 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	1.132.336,28	0,10	
. CDB 444 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	1.255.517,62	0,11	
. CDB 472 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	281.853,48	0,02	
. CDB 473 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	115.954,88	0,01	
. CDB 475 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	232.137,51	0,02	0,57
. CDB 182 DIAS - CACIQUE	PÓS	2	42.261,01	0,00	0,00
. CDB 180 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	2	1.499.205,89	0,13	
. CDB 182 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.081.299,12	0,09	
. CDB 210 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	308.707,08	0,03	
. CDB 211 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	264.015,71	0,02	
. CDB 212 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	266.592,92	0,02	
. CDB 218 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	105.606,82	0,01	
. CDB 219 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	210.081,08	0,02	
. CDB 225 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	117.256,13	0,01	
. CDB 226 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	52.255,13	0,00	
. CDB 238 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	265.242,12	0,02	
. CDB 259 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	186.745,29	0,02	
. CDB 260 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	186.022,29	0,02	
. CDB 264 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	26.526,77	0,00	
. CDB 266 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	150.673,78	0,01	
. CDB 304 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	533.343,47	0,05	
. CDB 308 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.185.419,42	0,10	
. CDB 310 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	94.534,15	0,01	
. CDB 311 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	2	511.451,89	0,04	
. CDB 318 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	81.288,49	0,01	
. CDB 329 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	2	180.512,55	0,02	
. CDB 331 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	2	955.732,03	0,08	
. CDB 332 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	2	597.158,64	0,05	
. CDB 333 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	867.445,07	0,07	
. CDB 367 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	211.830,15	0,02	

. CDB 386 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.329.277,75	0,11	
. CDB 388 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.120.229,20	0,10	
. CDB 389 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	417.358,36	0,04	1,10
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	2	14.159.185,12	1,21	1,21
. CDB 381 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	1.129.621,80	0,10	
. CDB 395 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	110.405,94	0,01	
. CDB 410 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	52.584,47	0,00	
. CDB 414 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	2.261.212,23	0,19	
. CDB 441 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	52.603,08	0,00	
. CDB 444 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	1.220.434,55	0,10	
. CDB 475 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	231.440,17	0,02	0,43
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	2	14.494.799,91	1,24	
. CDB 1856 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	7.292.330,81	0,62	1,87
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.303.165,98	0,45	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.215.877,24	0,45	0,90
. CDB 181 DIAS - PINE	PÓS	1	161.372,37	0,01	
. CDB 182 DIAS - PINE	PÓS	1	165.663,69	0,01	
. CDB 364 DIAS - PINE	PÓS	1	52.552,54	0,00	
. CDB 366 DIAS - PINE	PÓS	1	735.477,94	0,06	
. CDB 379 DIAS - PINE	PÓS	1	198.353,21	0,02	
. CDB 380 DIAS - PINE	PÓS	1	110.320,22	0,01	
. CDB 387 DIAS - PINE	PÓS	1	210.132,92	0,02	
. CDB 394 DIAS - PINE	PÓS	1	52.532,88	0,00	
. CDB 395 DIAS - PINE	PÓS	1	326.754,08	0,03	0,17
. CDB 3536 DIAS - PROSPER	PÓS	1	6.166.487,23	0,53	
. CDB 3652 DIAS - PROSPER	PÓS	1	6.166.573,91	0,53	1,06
. CDB 257 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	3.123.334,04	0,27	
. CDB 315 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	1.147.323,92	0,10	
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	9.473.120,76	0,81	
. CDB 1827 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	653.202,85	0,06	1,23
. CDB 227 DIAS - SOFISA	PÓS	2	2.585.128,10	0,22	
. CDB 239 DIAS - SOFISA	PÓS	1	93.841,63	0,01	
. CDB 252 DIAS - SOFISA	PÓS	3	372.828,05	0,03	
. CDB 257 DIAS - SOFISA	PÓS	2	3.123.122,12	0,27	
. CDB 315 DIAS - SOFISA	PÓS	1	1.147.807,78	0,10	
. CDB 326 DIAS - SOFISA	PÓS	1	382.468,39	0,03	
. CDB 339 DIAS - SOFISA	PÓS	1	159.396,94	0,01	
. CDB 354 DIAS - SOFISA	PÓS	1	106.293,25	0,01	
. CDB 358 DIAS - SOFISA	PÓS	1	2.285.417,41	0,20	
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	3.185.075,22	0,27	1,15
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	2	9.290.743,22	0,80	0,80
Letra Financeira Subordinada		35,00	11.856.395,38	1,02	
. PINE		17	5.769.160,39	0,49	0,49
. ABC		17	5.605.232,95	0,48	0,48
. BONSUCESSO		1	482.002,04	0,04	0,04
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		12.724.133,90	76.224.978,55	6,53	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	42.849,86	0,00	0,00
. BRADESCO DI FIF ASSISTENCIAL		6.215.783,48	21.612.175,30	1,85	1,85
. REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		11,56	9.176,08	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		4.469.481,36	6.279.867,13	0,54	0,54
. BNP PARIBAS SMART		214,85	1.508,63	0,00	0,00
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,15	5.398.339,49	0,46	0,46
. BTG PACTUAL		1.963.199,99	2.035.992,31	0,17	0,17
. SAFRA INSTITUCIONAL		31.923,15	5.403.129,41	0,46	0,46
. FIDC COMANCHE		50,00	245.109,09	0,02	0,02
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		4.467,00	4.130.482,94	0,35	0,35
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,99	5.818.270,25	0,50	0,50
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.999,99	14.669.337,17	1,26	1,26
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		10.082,14	10.578.740,89	0,91	0,91
Debêntures		20.609	35.526.972,04	3,04	
. CPFL ENERGIA		1.101	11.234.681,33	0,96	0,96
. ELETROMETRÔ		10.248	6.573.736,72	0,56	0,56
. PETROBRÁS		1.760	4.023.652,57	0,34	0,34
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	6.169.560,78	0,53	0,53
. ECOPISTAS		7.000	7.525.340,64	0,64	0,64

Outros Títulos		16.524	198.684.920,90	17,01	
. Certificado de Recebíveis Imobiliários		52	18.316.754,13	1,57	1,57
. Cédula de Crédito Bancário		20	43.007.291,67	3,68	3,68
. Certificado de Cédula de Créd. Bancário		3	118.364.246,05	10,13	10,13
. Depósito a Prazo com Garantia Especial		16.449	18.996.629,05	1,63	1,63
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			203.523.066,19	17,42	
B1. Mercado de Ações			89.787.050,72	7,69	
Companhias Abertas		5.477.224	74.304.174,35	6,36	
. ALL AMER LAT	ON	108.778	1.428.255,14	0,12	
. AMBEV	PN	33.040	1.695.943,20	0,15	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	100.550	2.664.575,00	0,23	
. BR MALLS PAR	ON	75.200	1.342.320,00	0,11	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	199.900	2.064.967,00	0,18	
. CONFAB	PN	100.967	434.158,10	0,04	
. COPEL	PNB	39.770	1.650.455,00	0,14	
. ECODIESEL	ON	828.900	580.230,00	0,05	
. ECORODOVIAS	ON	47.900	649.045,00	0,06	
. ELETROBRÁS	ON	80.977	1.691.609,53	0,14	
. GERDAU - GGBR	PN	89.778	1.463.381,40	0,13	
. HYPERMARCAS	ON	62.600	920.220,00	0,08	
. ITAUSA	PN	327.789	3.930.190,11	0,34	
. ITAUSA - RECIBO SUBSCRIÇÃO	PN	2.793	33.488,07	0,00	
. LOCALIZA	ON	27.600	770.040,00	0,07	
. MARCOPOLO	PN	64.300	450.100,00	0,04	
. MARFRIG	ON	79.800	1.228.920,00	0,11	
. OGX PETRÓLEO	ON	344.600	5.027.714,00	0,43	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	38.479	2.776.259,85	0,24	
. PDG REALT	ON	266.334	2.341.075,86	0,20	
. PETROBRÁS	PN	611.259	14.499.063,48	1,24	
. POSITIVO INF	ON	78.400	564.480,00	0,05	
. RANDON PART	PN	56.650	702.460,00	0,06	
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	84.242	1.616.603,98	0,14	
. SUZANO PAPEL	PNA	33.350	376.521,50	0,03	
. TAIPE	ON	1.300.000	8.723.000,00	0,75	
. TELESP	PN	31.508	1.430.463,20	0,12	
. TIM PART S/A	PN	76.800	579.840,00	0,05	
. TRACTEBEL	ON	33.500	921.250,00	0,08	
. VALE R. DOCE	PNA	251.460	11.225.174,40	0,96	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			522.370,53	0,04	
Instituições Financeiras		469.531	15.482.876,37	1,33	
. BRADESCO	PN	71.713	2.273.302,10	0,19	
. BRASIL	ON	159.552	4.467.456,00	0,38	
. ITAU	PN	238.266	8.684.795,70	0,74	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			57.322,57	0,00	
B2. Mercado de Opções		-344.600	-358.537,00	-0,03	
. OGX PETRÓLEO	ON	-344.600	-358.537,00	-0,03	
B3. Fundos		14.594.745,55	114.094.552,47	9,77	
. SCHRODERS FIA EXCLUSIVO		438.916,55	46.016.318,13	3,94	
. FATOR SINERGIA		15.105,99	20.802.299,58	1,78	
. GERAÇÃO FUTURO		12.032.181,42	20.128.009,43	1,72	
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		161.800,49	16.859.059,89	1,44	
. CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA		896.741,11	9.238.865,44	0,79	
. M. SQUARE PIPE FIA		1.050.000,00	1.050.000,00	0,09	
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		167.108,58	38.651.906,38	3,31	
. GOVERNANÇA E GESTÃO		10.689,42	4.487.327,55	0,38	
. GOVERNANÇA E GESTÃO II		6.736,32	6.050.406,65	0,52	
. FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES		668,84	4.112.156,59	0,35	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		1.004	923.116,66	0,08	
. MEMORIAL OFFICE		10.000	998.499,93	0,09	
. ÁGUA BRANCA		39.000	11.699.610,00	1,00	
. BRAZILIAN CAPITAL		99.010	10.237.634,00	0,88	
. Valores a receber			143.155,00	0,01	

D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			51.598.011,70	4,42	
D1 - Investimentos em Shopping Center			40.166.218,95	3,44	
Shopping Tatuapé II			11.511.608,72	0,99	
Shopping Plaza Sul			20.398.687,37	1,75	
Shopping Metrô Itaquera			7.750.225,84	0,66	
. Valores a receber			505.697,02	0,04	
D2 - Investimento Imobiliário			11.431.792,75	0,98	
. PANAMBY			12.441.286,84	1,07	
. Valores a pagar (-)			-1.009.494,09	-0,09	
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		4,221	64.119.015,48	5,49	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		4,221	64.165.164,96	5,49	
. VALORES A PAGAR (-)			-73.118,43	-0,01	
. VALORES A RECEBER			26.968,95	0,00	
F - OUTROS			1.925.522,87	0,16	
. Disponíveis			2.315.250,52	0,20	
. Outros realizáveis			512.660,75	0,04	
. Outras exigibilidades			-902.388,40	-0,08	

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- SCHRODERS FIA EXCLUSIVO	46.016.318,13	20,10%	3,94%
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	42.849,86	0,02%	0,00%
- BNP PARIBAS SMART	1.508,63	0,00%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA	20.802.299,58	9,09%	1,78%
- GERAÇÃO FUTURO	20.128.009,43	8,79%	1,72%
- RB.FUNDAMENTAL	16.859.059,89	7,36%	1,44%
- BTG PACTUAL	2.035.992,31	0,89%	0,17%
- SAFRA INSTITUCIONAL	5.403.129,41	2,36%	0,46%
- CSHG STRATEGY INST.FICFIA IBOVESPA	9.238.865,44	4,03%	0,79%
- M. SQUARE PIPE FIA	1.050.000,00	0,46%	0,09%
- FIDC COMANCHE	245.109,09	0,11%	0,02%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	4.130.482,94	1,80%	0,35%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	5.818.270,25	2,54%	0,50%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	14.669.337,17	6,41%	1,26%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	10.578.740,89	4,62%	0,91%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS CP FIC DE FI	5.398.339,49	2,36%	0,46%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	9.176,08	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	6.279.867,13	2,74%	0,54%
FUNDO EXCLUSIVO			
- METRUS DI FIF BRAM - ASSISTENCIAL	21.612.175,30	9,44%	1,85%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO	4.487.327,55	1,96%	0,38%
- GOVERNANÇA E GESTÃO II	6.050.406,65	2,64%	0,52%
- FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES	4.112.156,59	1,80%	0,35%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	923.116,66	0,40%	0,08%
- MEMORIAL OFFICE	1.004.399,93	0,44%	0,09%
- ÁGUA BRANCA	11.787.360,00	5,15%	1,01%
- BRAZILIAN CAPITAL	10.287.139,00	4,49%	0,88%
TOTAL	228.971.437,40	100,00%	19,60%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	731.958.846,76	77,95%	62,67%
RENTA VARIÁVEL	89.428.513,72	9,52%	7,66%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	51.598.011,70	5,49%	4,42%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	64.119.015,48	6,83%	5,49%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.925.522,87	0,21%	0,16%
TOTAL	939.029.910,53	100,00%	80,40%