

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2011

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			747.740.491,03		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			538.568.984,96	72,03	
<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>		122.263	264.983.764,69	35,44	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			119.128.331,00	15,93	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		65	86.618.629,61	11,58	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	1	7.131.678,20	0,95	0,95
. CDB 365 DIAS - BANIF	PÓS	1	3.685.864,64	0,49	0,49
. CDB 234 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	214.847,08	0,03	
. CDB 248 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	268.579,95	0,04	
. CDB 257 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	2.507.575,43	0,34	
. CDB 262 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	214.880,99	0,03	
. CDB 276 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	107.449,02	0,01	
. CDB 297 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	161.191,59	0,02	
. CDB 304 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	214.930,76	0,03	
. CDB 311 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	200.968,33	0,03	
. CDB 315 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	1.145.064,43	0,15	0,67
. CDB 227 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	2.155.695,84	0,29	
. CDB 381 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	1.132.336,28	0,15	
. CDB 444 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	1.255.517,62	0,17	
. CDB 472 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	281.853,48	0,04	
. CDB 473 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	115.954,88	0,02	
. CDB 475 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	232.137,51	0,03	0,69
. CDB 304 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	533.343,47	0,07	
. CDB 308 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.185.419,42	0,16	
. CDB 310 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	94.534,15	0,01	
. CDB 311 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	2	511.451,89	0,07	
. 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	0,13	
. CDB 332 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	2	597.158,64	0,08	
. CDB 333 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	867.445,07	0,12	
. CDB 367 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	211.830,15	0,03	
. CDB 386 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.329.277,75	0,18	
. CDB 388 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.120.229,20	0,15	
. CDB 389 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	417.358,36	0,06	1,08
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	8.713.830,37	1,17	1,17
. CDB 381 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	1.129.621,80	0,15	
. CDB 395 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	110.405,94	0,01	
. CDB 410 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	52.584,47	0,01	
. CDB 414 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	2.261.212,23	0,30	
. CDB 441 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	52.603,08	0,01	
. CDB 444 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	1.220.434,55	0,16	
. CDB 475 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	231.440,17	0,03	0,68
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	10.146.434,67	1,36	1,36
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.002.713,17	0,27	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.249.711,12	0,43	0,70
. CDB 364 DIAS - PINE	PÓS	1	52.552,54	0,01	
. CDB 366 DIAS - PINE	PÓS	1	735.477,94	0,10	
. CDB 379 DIAS - PINE	PÓS	1	198.353,21	0,03	
. CDB 380 DIAS - PINE	PÓS	1	110.320,22	0,01	
. CDB 387 DIAS - PINE	PÓS	1	210.132,92	0,03	
. CDB 394 DIAS - PINE	PÓS	1	52.532,88	0,01	
. CDB 395 DIAS - PINE	PÓS	1	326.754,08	0,04	0,23

. CDB 3536 DIAS - PROSPER	PÓS	1	6.166.487,23	0,82	0,82
. CDB 257 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	2.511.591,37	0,34	
. CDB 315 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	1.147.323,92	0,15	0,49
. CDB 227 DIAS - SOFISA	PÓS	1	2.154.273,42	0,29	
. CDB 239 DIAS - SOFISA	PÓS	1	93.841,63	0,01	
. CDB 252 DIAS - SOFISA	PÓS	1	240.703,53	0,03	
. CDB 257 DIAS - SOFISA	PÓS	1	2.511.420,96	0,34	
. CDB 315 DIAS - SOFISA	PÓS	1	1.147.807,78	0,15	
. CDB 326 DIAS - SOFISA	PÓS	1	382.468,39	0,05	
. CDB 339 DIAS - SOFISA	PÓS	1	159.396,94	0,02	
. CDB 354 DIAS - SOFISA	PÓS	1	106.293,25	0,01	
. CDB 358 DIAS - SOFISA	PÓS	1	2.285.417,41	0,31	1,21
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	7.742.381,22	1,04	1,04
Letra Financeira Subordinada		33,00	10.886.896,19	1,46	
. PINE		16	5.281.663,24	0,71	0,71
. ABC		17	5.605.232,95	0,75	0,75
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		38.855,22	21.622.805,20	2,89	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	42.849,86	0,01	0,01
. BNP PARIBAS SMART		214,85	1.508,63	0,00	0,00
. SAFRA INSTITUCIONAL		17.960,95	3.039.968,05	0,41	0,41
. FIDC COMANCHE		25,00	122.554,52	0,02	0,02
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		3.467,00	3.205.816,95	0,43	0,43
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,00	3.162.015,89	0,42	0,42
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	6.845.690,67	0,92	0,92
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	5.202.400,63	0,70	0,70
Debêntures		16.734	24.314.121,70	3,25	
. CPFL ENERGIA		800	8.163.256,19	1,09	1,09
. ELETROMETRÔ		7.174	4.601.872,30	0,62	0,62
. PETROBRÁS		1.760	4.023.652,57	0,54	0,54
. ECOPISTAS		7.000	7.525.340,64	1,01	1,01
Outros Títulos		11.051	130.142.767,57	17,40	
. Certificado de Recebíveis Imobiliários		34	13.027.935,53	1,74	1,74
. Cédula de Crédito Bancário		17	33.750.750,03	4,51	4,51
. Certificado de Cédula de Créd. Bancário		1	71.735.718,47	9,59	9,59
. Depósito a Prazo com Garantia Especial		10.999	11.628.363,54	1,56	1,56
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			113.153.456,82	15,13	
B1. Mercado de Ações			50.737.877,86	6,79	
Companhias Abertas		3.448.779	42.439.388,97	5,68	
. ALL AMER LAT	ON	56.666	744.024,58	0,10	
. AMBEV	PN	17.740	910.594,20	0,12	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	55.424	1.468.736,00	0,20	
. BR MALLS PAR	ON	42.500	758.625,00	0,10	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	100.700	1.040.231,00	0,14	
. CONFAB	PN	55.691	239.471,30	0,03	
. COPEL	PNB	22.573	936.779,50	0,13	
. ECODIESEL	ON	460.000	322.000,00	0,04	
. ECORODOVIAS	ON	26.500	359.075,00	0,05	
. ELETROBRÁS	ON	44.588	931.443,32	0,12	
. GERDAU - GGBR	PN	47.964	781.813,20	0,10	
. HYPERMARCAS	ON	34.000	499.800,00	0,07	
. ITAUSA	PN	173.484	2.080.073,16	0,28	
. ITAUSA - RECIBO SUBSCRIÇÃO	PN	1.417	16.989,83	0,00	
. LOCALIZA	ON	15.500	432.450,00	0,06	
. MARCOPOLO	PN	35.800	250.600,00	0,03	
. MARFRIG	ON	43.000	662.200,00	0,09	
. OGX PETRÓLEO	ON	71.400	1.041.726,00	0,14	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	21.519	1.552.595,85	0,21	
. PDG REALT	ON	144.792	1.272.721,68	0,17	
. PETROBRÁS	PN	328.317	7.787.679,24	1,04	
. POSITIVO INF	ON	41.300	297.360,00	0,04	
. RANDON PART	PN	31.300	388.120,00	0,05	

. SID. NACIONAL - CSNA	ON	46.308	888.650,52	0,12
. SUZANO PAPEL	PNA	18.500	208.865,00	0,03
. TAIPE	ON	1.300.000	8.723.000,00	1,17
. TELESP	PN	17.169	779.472,60	0,10
. TIM PART S/A	PN	42.700	322.385,00	0,04
. TRACTEBEL	ON	18.600	511.500,00	0,07
. VALE R. DOCE	PNA	133.327	5.951.717,28	0,80
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			278.689,71	0,04
<u>Instituições Financeiras</u>		<u>251.794</u>	<u>8.298.488,89</u>	<u>1,11</u>
. BRADESCO	PN	36.958	1.171.568,60	0,16
. BRASIL	ON	86.947	2.434.516,00	0,33
. ITAU	PN	127.889	4.661.554,05	0,62
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			30.850,24	0,00
<u>B2. Mercado de Opções</u>		<u>-71.400</u>	<u>-62.118,00</u>	<u>-0,01</u>
. OGX PETRÓLEO	ON	-71.400	-62.118,00	-0,01
<u>B3. Fundos</u>		<u>5.924.654,25</u>	<u>62.477.696,96</u>	<u>8,36</u>
. SCHRODERS FIA EXCLUSIVO		292.926,48	30.710.617,66	4,11
. FATOR SINERGIA		6.744,90	9.288.319,84	1,24
. GERAÇÃO FUTURO		5.043.587,01	8.437.153,38	1,13
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		80.218,87	8.358.532,82	1,12
. CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA		500.651,99	5.158.073,26	0,69
. M. SQUARE PIPE FIA		525,00	525.000,00	0,07
<u>C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</u>		<u>86.455,24</u>	<u>17.421.348,58</u>	<u>2,33</u>
. GOVERNANÇA E GESTÃO II		6.736,32	6.050.406,65	0,81
. FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES		510,92	3.141.230,73	0,42
. BRAZILIAN CAPITAL		79.208	8.190.107,20	1,10
. Valores a receber			39.604,00	0,01
<u>D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</u>			<u>43.847.785,86</u>	<u>5,86</u>
<u>D1 - Investimentos em Shopping Center</u>			<u>32.415.993,11</u>	<u>4,34</u>
. Shopping Tatuapé II			11.511.608,72	1,54
. Shopping Plaza Sul			20.398.687,37	2,73
. Valores a receber			505.697,02	0,07
<u>D2 - Investimento Imobiliário</u>			<u>11.431.792,75</u>	<u>1,53</u>
. PANAMBY			12.441.286,84	1,66
. Valores a pagar (-)			-1.009.494,09	-0,14
<u>E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES</u>		<u>2.303</u>	<u>33.433.820,39</u>	<u>4,47</u>
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.303	33.485.215,69	4,48
. VALORES A PAGAR (-)			-51.707,25	-0,01
. VALORES A RECEBER			311,95	0,00
<u>F - OUTROS</u>			<u>1.315.094,42</u>	<u>0,18</u>
. Disponíveis			1.173.062,94	0,16
. Outros Realizáveis			416.011,86	0,06
. Outras Exigibilidades			-273.980,38	-0,04

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- SCHRODERS FIA EXCLUSIVO	30.710.617,66	30,25%	4,11%
FUNDOS			
- ABN FIC REF. DI. PROFIT PREMIUM	42.849,86	0,04%	0,01%
- BNP PARIBAS SMART	1.508,63	0,00%	0,00%
- FIDC COMANCHE	122.554,52	0,12%	0,02%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST ENERGIA ELETRICA	3.205.816,95	3,16%	0,43%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	3.162.015,89	3,11%	0,42%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	6.845.690,67	6,74%	0,92%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	5.202.400,63	5,12%	0,70%
- FUNDO FATOR SINERGIA	9.288.319,84	9,15%	1,24%
- GERAÇÃO FUTURO	8.437.153,38	8,31%	1,13%
- RB.FUNDAMENTAL	8.358.532,82	8,23%	1,12%
- CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA	5.158.073,26	5,08%	0,69%
- M. SQUARE PIPE FIA	525.000,00	0,52%	0,07%
- SAFRA INSTITUCIONAL	3.039.968,05	2,99%	0,41%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO II	6.050.406,65	5,96%	0,81%
- FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES	3.141.230,73	3,09%	0,42%
- BRAZILIAN CAPITAL	8.229.711,20	8,11%	1,10%
TOTAL	101.521.850,74	100,00%	13,58%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	516.946.179,76	80,00%	69,13%
RENDA VARIÁVEL	50.675.759,86	7,84%	6,78%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	43.847.785,86	6,79%	5,86%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	33.433.820,39	5,17%	4,47%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.315.094,42	0,20%	0,18%
TOTAL	646.218.640,29	100,00%	86,42%