

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2011

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			311.639.853,23		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			172.955.848,18	55,50	
<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>		16.471	30.288.412,10	9,72	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			96.277.752,11	30,89	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		40	80.725.721,59	25,90	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	2	14.502.882,25	4,65	4,65
. CDB 365 DIAS - BANIF	PÓS	1	3.685.864,64	1,18	1,18
. CDB 942 DIAS - BBM	PÓS	1	3.031.795,14	0,97	
. CDB 1170 DIAS - BBM	PÓS	1	7.961.245,46	2,55	3,53
. CDB 257 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	610.764,51	0,20	0,20
. CDB 181 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	946.462,49	0,30	
. CDB 227 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	538.923,96	0,17	0,48
. CDB 180 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	2	1.499.205,89	0,48	
. CDB 182 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.081.299,12	0,35	
. CDB 210 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	308.707,08	0,10	
. CDB 211 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	264.015,71	0,08	
. CDB 212 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	266.592,92	0,09	
. CDB 218 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	105.606,82	0,03	
. CDB 219 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	210.081,08	0,07	
. CDB 225 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	117.256,13	0,04	
. CDB 226 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	52.255,13	0,02	
. CDB 238 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	265.242,12	0,09	
. CDB 259 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	186.745,29	0,06	
. CDB 260 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	186.022,29	0,06	
. CDB 264 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	26.526,77	0,01	
. CDB 266 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	150.673,78	0,05	1,51
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	5.445.354,75	1,75	1,75
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	4.348.365,24	1,40	
. CDB 1856 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	7.292.330,81	2,34	3,74
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.300.452,81	1,06	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	1.966.166,12	0,63	1,69
. CDB 181 DIAS - PINE	PÓS	1	161.372,37	0,05	
. CDB 182 DIAS - PINE	PÓS	1	165.663,69	0,05	0,10
. CDB 3652 DIAS - PROSPER	PÓS	1	6.166.573,91	1,98	1,98
. CDB 257 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	611.742,67	0,20	
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	9.473.120,76	3,04	3,24
. CDB 227 DIAS - SOFISA	PÓS	1	430.854,68	0,14	
. CDB 252 DIAS - SOFISA	PÓS	1	20.416,82	0,01	
. CDB 257 DIAS - SOFISA	PÓS	1	611.701,16	0,20	
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	3.185.075,22	1,02	1,36
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	1.548.362,00	0,50	0,50
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		1.953.658,59	15.552.030,52	4,99	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,15	5.398.339,49	1,73	1,73
. BTG PACTUAL		1.933.199,99	2.004.879,96	0,64	0,64
. SAFRA INSTITUCIONAL		8.260,46	1.398.118,58	0,45	0,45
. FIDC COMANCHE		17,00	83.337,08	0,03	0,03
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER		2.474,99	1.660.158,97	0,53	0,53
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	2.933.867,43	0,94	0,94
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	2.073.329,01	0,67	0,67
<u>Debêntures</u>		3.875	11.212.850,34	3,60	
. CPFL ENERGIA		301	3.071.425,14	0,99	0,99
. ELETROMETRÔ		3.074	1.971.864,42	0,63	0,63
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	6.169.560,78	1,98	1,98

<u>Outros Títulos</u>		<u>3.021</u>	<u>35.176.833,63</u>	<u>11,29</u>	
. Certificado de Recebíveis Imobiliários		18	5.288.818,60	1,70	1,70
. Cédula de Crédito Bancário		2	4.832.893,87	1,55	1,55
. Certificado de Cédula de Créd. Bancário		1	20.923.204,76	6,71	6,71
. Depósito a Prazo com Garantia Especial		3.000	4.131.916,40	1,33	1,33
<u>B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL</u>			<u>78.382.221,03</u>	<u>25,16</u>	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			<u>36.600.443,16</u>	<u>11,75</u>	
<u>Companhias Abertas</u>		<u>1.883.505,00</u>	<u>29.608.841,21</u>	<u>9,50</u>	
. ALL AMER LAT	ON	50.785	666.807,05	0,21	
. AMBEV	PN	14.835	761.480,55	0,24	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	43.854	1.162.131,00	0,37	
. BR MALLS PAR	ON	31.800	567.630,00	0,18	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	96.400	995.812,00	0,32	
. CONFAB	PN	44.323	190.588,90	0,06	
. COPEL	PNB	16.752	695.208,00	0,22	
. ECODIESEL	ON	362.800	253.960,00	0,08	
. ECORODOVIAS	ON	20.700	280.485,00	0,09	
. ELETROBRÁS	ON	35.449	740.529,61	0,24	
. GERDAU - GGBR	PN	40.724	663.801,20	0,21	
. HYPERMARCAS	ON	28.000	411.600,00	0,13	
. ITAUSA	PN	149.895	1.797.241,05	0,58	
. ITAUSA - RECIBO SUBSCRIÇÃO	PN	1.335	16.006,65	0,01	
. LOCALIZA	ON	12.100	337.590,00	0,11	
. MARCOPOLO	PN	27.500	192.500,00	0,06	
. MARFRIG	ON	35.700	549.780,00	0,18	
. OGX PETRÓLEO	ON	173.300	2.528.447,00	0,81	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	16.453	1.187.083,95	0,38	
. PDG REALT	ON	118.054	1.037.694,66	0,33	
. PETROBRÁS	PN	274.677	6.515.338,44	2,09	
. POSITIVO INF	ON	36.600	263.520,00	0,08	
. RANDON PART	PN	24.600	305.040,00	0,10	
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	36.738	705.002,22	0,23	
. SUZANO PAPEL	PNA	14.375	162.293,75	0,05	
. TELESP	PN	13.839	628.290,60	0,20	
. TIM PART S/A	PN	33.000	249.150,00	0,08	
. TRACTEBEL	ON	14.500	398.750,00	0,13	
. VALE R. DOCE	PNA	114.417	5.107.574,88	1,64	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			237.504,70	0,08	
<u>Instituições Financeiras</u>		<u>211.921</u>	<u>6.991.601,95</u>	<u>2,25</u>	
. BRADESCO	PN	33.732	1.069.304,40	0,34	
. BRASIL	ON	70.826	1.983.128,00	0,64	
. ITAU	PN	107.363	3.913.381,35	1,26	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			25.788,20	0,01	
<u>B2. Mercado de Opções</u>		<u>-173.300</u>	<u>-150.771,00</u>	<u>-0,05</u>	
. OGX PETRÓLEO	ON	-173.300	-150.771,00	-0,05	
<u>B3. Fundos</u>		<u>5.104.991,42</u>	<u>41.932.548,87</u>	<u>13,46</u>	
. SCHRODERS FIA EXCLUSIVO		145.990,06	15.305.700,47	4,91	
. FATOR SINERGIA		5.784,10	7.965.221,79	2,56	
. GERAÇÃO FUTURO		4.111.805,21	6.878.425,92	2,21	
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		70.322,92	7.327.408,51	2,35	
. CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA		396.089,12	4.080.792,18	1,31	
. M. SQUARE PIPE FIA		375.000,00	375.000,00	0,12	
<u>C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</u>		<u>80.653,34</u>	<u>21.230.557,80</u>	<u>6,81</u>	
. GOVERNANÇA E GESTÃO		10.689,42	4.487.327,55	1,44	
. FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES		157,92	970.925,86	0,31	
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		1.004	923.116,66	0,30	
. MEMORIAL OFFICE		10.000	998.499,93	0,32	
. ÁGUA BRANCA		39.000	11.699.610,00	3,75	
. BRAZILIAN CAPITAL		19.802	2.047.526,80	0,66	
. Valores a receber			103.551,00	0,03	

D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			7.750.225,84	2,49	
D1 - Investimentos em Shopping Center			7.750.225,84	2,49	
Shopping Metrô Itaquera			7.750.225,84	2,49	
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		1.918	30.685.195,09	9,84	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		1.918	30.679.949,27	9,84	
. VALORES A PAGAR (-)			-21.411,18	-0,01	
. VALORES A RECEBER			26.657,00	0,01	
F - OUTROS			635.805,29	0,20	
. Disponíveis			654.903,67	0,21	
. Outros Realizáveis			96.648,89	0,03	
. Outras Exigibilidades			-115.747,27	-0,04	

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- SCHRODERS FIA EXCLUSIVO	15.305.700,47	19,44%	4,91%
FUNDOS			
- BRZ MUTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI	5.398.339,49	6,86%	1,73%
- BTG PACTUAL	2.004.879,96	2,55%	0,64%
- SAFRA INSTITUCIONAL	1.398.118,58	1,78%	0,45%
- FIDC COMANCHE	83.337,08	0,11%	0,03%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	1.660.158,97	2,11%	0,53%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	2.933.867,43	3,73%	0,94%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	2.073.329,01	2,63%	0,67%
- FUNDO FATOR SINERGIA	7.965.221,79	10,12%	2,56%
- GERAÇÃO FUTURO	6.878.425,92	8,74%	2,21%
- RB FUNDAMENTAL INST. FIA	7.327.408,51	9,31%	2,35%
- CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA	4.080.792,18	5,18%	1,31%
- M SQUARE PIPE FIA	375.000,00	0,48%	0,12%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO	4.487.327,55	5,70%	1,44%
- FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES	970.925,86	1,23%	0,31%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	923.116,66	1,17%	0,30%
- MEMORIAL OFFICE	1.004.399,93	1,28%	0,32%
- ÁGUA BRANCA	11.787.360,00	14,97%	3,78%
- BRAZILIAN CAPITAL	2.057.427,80	2,61%	0,66%
TOTAL	78.715.137,19	100,00%	25,25%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	157.403.817,66	67,58%	50,51%
RENDA VARIÁVEL	36.449.672,16	15,65%	11,70%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	7.750.225,84	3,33%	2,49%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	30.685.195,09	13,17%	9,85%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	635.805,29	0,27%	0,20%
TOTAL	232.924.716,04	100,00%	74,75%