

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2012

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			857.469.168,77		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			610.437.635,95	71,19	
<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>		132.413	329.701.358,59	38,45	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			103.818.660,12	12,11	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		6	71.221.087,50	8,31	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	1	8.216.312,70	0,96	0,96
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	2	32.850.662,41	3,83	3,83
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	9.936.019,65	1,16	1,16
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	11.428.427,94	1,33	1,33
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,24	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,39	0,63
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	8.789.664,80	1,03	1,03
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS		-2	-5.432.605,06	-0,63	-0,63
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		33	11.980.371,97	1,40	
. ABC		17	6.431.425,82	0,75	0,75
. PINE		16	5.548.946,15	0,65	0,65
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		4.962.337,67	20.617.200,65	2,40	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	47.401,17	0,01	0,01
. BNP PARIBAS SMART		214,85	1.669,06	0,00	0,00
. SAFRA INSTITUCIONAL		20.987,60	3.937.066,00	0,46	0,46
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		3.467,00	2.844.675,50	0,33	0,33
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.714,00	1.649.191,38	0,19	0,19
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	3.988.979,78	0,47	0,47
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	3.010.026,36	0,35	0,35
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		4.920.479,30	5.088.052,38	0,59	0,59
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I		0,50	50.139,02	0,01	0,01
<u>Debêntures</u>		2.516.764	41.821.214,36	4,88	
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		30	14.720.075,96	1,72	1,72
. COMANCHE PART.		2.500.000	3.132.985,05	0,37	0,37
. CPFL ENERGIA		800	8.190.053,80	0,96	0,96
. ELETROMETRÔ		7.174	3.460.185,77	0,40	0,40
. ECOPISTAS		7.000	8.166.053,51	0,95	0,95
. PETROBRÁS		1.760	4.151.860,27	0,48	0,48
<u>Outros Títulos</u>		19.060	135.096.402,88	15,76	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIÁRIOS		44	13.943.754,85	1,63	1,63
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		16	27.189.552,84	3,17	3,17
. CERTIFICADO DE CEDULA DE CREDITO BANCARIO		1	71.834.781,02	8,38	8,38
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		18.999	21.873.098,75	2,55	2,55
. VALORES A RECEBER			829.327,77	0,10	0,10
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-574.112,35	-0,07	-0,07

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			118.767.363,72	13,85
B1. Mercado de Ações			54.924.391,37	6,41
Companhias Abertas		5.056.500	46.903.531,21	5,47
. ALL AMER LAT	ON	144.066	1.221.679,68	0,14
. AMBEV	DIR	9	695,70	0,00
. AMBEV	PN	3.795	293.353,50	0,03
. BRF - BRASIL FOODS	ON	75.524	2.295.174,36	0,27
. BR MALLS PAR	ON	33.200	763.600,00	0,09
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	151.000	1.547.750,00	0,18
. COPEL	PNB	25.273	1.117.066,60	0,13
. ECORODOVIAS	ON	29.100	470.547,00	0,05
. ELETROBRÁS	ON	75.188	1.071.429,00	0,12
. GAFISA	ON	63.800	167.794,00	0,02
. GERDAU - GGBR	PN	69.964	1.238.362,80	0,14
. HYPERMARCAS	ON	61.900	734.753,00	0,09
. ISHARES	CI	17.000	908.140,00	0,11
. ITAUSA	PN	374.241	3.181.048,50	0,37
. LOCALIZA	ON	18.200	552.370,00	0,06
. MARCOPOLO	PN	37.700	341.185,00	0,04
. MARFRIG	ON	69.200	646.328,00	0,08
. OGX PETRÓLEO	ON	135.000	742.500,00	0,09
. PÃO DE AÇUCAR	PN	19.819	1.585.520,00	0,18
. PDG REALT	ON	410.192	1.439.773,92	0,17
. PETROBRÁS	PN	496.417	9.059.610,25	1,06
. POSITIVO INF	ON	44.200	248.846,00	0,03
. RANDON PART	PN	56.600	509.400,00	0,06
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	79.708	907.077,04	0,11
. SUZANO PAPEL	PNA	29.400	116.718,00	0,01
. TAIPE	ON	1.300.000	8.723.000,00	1,02
. TELEF. BRASIL - VIVT	PN	11.469	573.220,62	0,07
. TIM PART S/A	ON	23.208	259.001,28	0,03
. TRACTEBEL	ON	19.500	724.425,00	0,08
. USIMINAS	PNA	123.000	777.360,00	0,09
. V-AGRO	ON	928.500	352.830,00	0,04
. VALE R. DOCE	ON	500	20.065,00	0,00
. VALE R. DOCE	PNA	129.827	5.084.025,32	0,59
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			122.137,91	0,01
. VALORES A PAGAR (-)			-893.256,27	-0,10
Instituições Financeiras		314.405	8.020.860,16	0,94
. BRADESCO	PN	31.658	947.840,52	0,11
. BRASIL	ON	110.547	2.158.982,91	0,25
. ITAUBANCO	PN	172.200	4.871.538,00	0,57
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			42.498,73	0,00
B2. Mercado de Opções		-232.600,00	-115.978,00	-0,01
. BMF BOVESPA	ON	-65.400	-64.746,00	-0,01
. OGX PETRÓLEO	ON	-25.000	-250,00	0,00
. PDG REALT	ON	-82.700	-42.177,00	0,00
. PETROBRAS	PN	-59.500	-8.805,00	0,00
B3. Fundos		9.135.316,72	63.958.950,35	7,46
. CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA		699.533,94	6.755.870,08	0,79
. FATOR SINERGIA		6.744,90	10.168.993,17	1,19
. GERAÇÃO FUTURO		6.305.892,54	9.240.434,22	1,08
. ITAU - UNIBANCO METRUS FIA		292.926,48	27.545.311,01	3,21
. M. SQUARE PIPE FIA		1.750.000,00	2.025.763,25	0,24
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		80.218,87	8.222.578,62	0,96
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		88.263,62	31.569.244,70	3,68
. GOVERNANÇA E GESTÃO II		7.510,63	5.983.007,05	0,70
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.280,99	10.634.565,50	1,24
. BRAZILIAN CAPITAL REAL ESTATE FUND. I FI IMOBILIARIO		79.208	12.237.636,00	1,43
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		264	2.648.055,89	0,31
. VALORES A RECEBER			65.980,26	0,01

D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			60.379.436,15	7,04	
D1 - Investimentos em Shopping Center			48.947.643,40	5,71	
. SHOPPING TATUAPE II			20.944.695,14	2,44	
. SHOPPING PLAZA SUL			27.463.825,30	3,20	
. VALORES A RECEBER			539.122,96	0,06	
D2 - Investimento Imobiliário			11.431.792,75	1,33	
. PANAMBY			12.144.487,33	1,42	
. VALORES A PAGAR (-)			-712.694,58	-0,08	
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.333	34.882.231,21	4,07	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.333	34.691.440,06	4,05	
. VALORES A PAGAR (-)			-37.059,77	0,00	
. VALORES A RECEBER			227.850,92	0,03	
F - OUTROS			1.433.257,04	0,17	
. DISPONIVEL			1.321.022,33	0,15	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			416.011,86	0,05	
. OUTROS REALIZAVEIS			416.659,73	0,05	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-304.425,02	-0,04	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-416.011,86	-0,05	

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- ITAU - UNIBANCO METRUS FIA	27.545.311,01	23,72%	3,21%
FUNDOS			
- ABN FIC REF. DI. PROFIT PREMIUM	47.401,17	0,04%	0,01%
- BNP PARIBAS SMART	1.669,06	0,00%	0,00%
- CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA	6.755.870,08	5,82%	0,79%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST ENERGIA ELETRICA	2.844.675,50	2,45%	0,33%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	1.649.191,38	1,42%	0,19%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	3.988.979,78	3,43%	0,47%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	3.010.026,36	2,59%	0,35%
- FIDC - BCSUL VERAX CPP 360	5.088.052,38	4,38%	0,59%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I	50.139,02	0,04%	0,01%
- SAFRA INSTITUCIONAL	3.937.066,00	3,39%	0,46%
- FUNDO FATOR SINERGIA	10.168.993,17	8,76%	1,19%
- GERAÇÃO FUTURO	9.240.434,22	7,96%	1,08%
- M. SQUARE PIPE FIA	2.025.763,25	1,74%	0,24%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	8.222.578,62	7,08%	0,96%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO II	5.983.007,05	5,15%	0,70%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	10.634.565,50	9,16%	1,24%
- BRAZILIAN CAPITAL REAL ESTATE FUND. I FI IMOBILIARIO	12.303.616,26	10,59%	1,43%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	2.648.055,89	2,28%	0,31%
TOTAL	116.145.395,70	100,00%	13,55%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	589.820.435,30	79,56%	68,78%
RENDA VARIÁVEL	54.808.413,37	7,39%	6,39%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	60.379.436,15	8,14%	7,04%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	34.882.231,21	4,71%	4,07%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.433.257,04	0,19%	0,17%
TOTAL	741.323.773,07	100,00%	86,45%