

## RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

## PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 30.06.2012

| DISCRIMINAÇÃO                                                                                                                      | Espécie<br>Tipo | Quantidade   | Valor em R\$          | Alocação do<br>patrimônio (%) | Diversificação<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|--------------|-----------------------|-------------------------------|-----------------------|
| <b>INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO</b>                                                                                             |                 |              | <b>373.886.192,02</b> |                               |                       |
| <b>A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA</b>                                                                                             |                 |              | <b>205.531.334,50</b> | <b>54,97</b>                  |                       |
| <u>TÍTULOS PÚBLICOS DE RESPONSABILIDADE DO<br/>TESOURO NACIONAL E/OU DO BACEN E CRÉDITOS<br/>SECURITIZADOS DO TESOURO NACIONAL</u> |                 |              |                       |                               |                       |
| <u>Nota do Tesouro Nacional</u>                                                                                                    |                 | 28.721       | 60.174.118,14         | 16,09                         |                       |
| <u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>                                                                                      |                 |              | 88.731.346,16         | 23,73                         |                       |
| <u>Certificado de Depósito Bancário</u>                                                                                            |                 | 11           | 70.309.574,41         | 18,81                         |                       |
| . CDB 1.826 DIAS - ABC                                                                                                             | PÓS             | 2            | 16.671.192,81         | 4,46                          | 4,46                  |
| . CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL                                                                                                  | PÓS             | 1            | 17.806.324,23         | 4,76                          | 4,76                  |
| . CDB 1826 DIAS - FIBRA                                                                                                            | PÓS             | 1            | 6.210.492,01          | 1,66                          | 1,66                  |
| . CDB 1653 DIAS - ITAÚ                                                                                                             | PÓS             | 1            | 4.897.974,04          | 1,31                          | 1,31                  |
| . CDB 1856 DIAS - ITAÚ                                                                                                             | PÓS             | 1            | 8.421.642,56          | 2,25                          | 2,25                  |
| . CDB 1826 DIAS - MORADA                                                                                                           | PÓS             | 1            | 3.403.988,49          | 0,91                          |                       |
| . CDB 1827 DIAS - MORADA                                                                                                           | PÓS             | 1            | 2.047.692,08          | 0,55                          | 1,46                  |
| . CDB 1826 DIAS - SCHAHIN                                                                                                          | PÓS             | 2            | 10.915.830,86         | 2,92                          | 2,92                  |
| . CDB 1827 DIAS - SOFISA                                                                                                           | PÓS             | 2            | 3.628.228,88          | 0,97                          | 0,97                  |
| . CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM                                                                                                       | PÓS             | 1            | 1.757.889,02          | 0,47                          | 0,47                  |
| . PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS                                                                                                  |                 | -2           | -5.451.680,57         | -1,46                         | -1,46                 |
| <u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>                                                                              |                 | 4.041.107,98 | 18.421.771,75         | 4,93                          |                       |
| . BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI                                                                                    |                 | 4.730,15     | 6.120.598,83          | 1,64                          | 1,64                  |
| . BTG PACTUAL                                                                                                                      |                 | 3.024.304,06 | 3.557.786,46          | 0,95                          | 0,95                  |
| . SAFRA INSTITUCIONAL                                                                                                              |                 | 20.525,93    | 3.850.461,94          | 1,03                          | 1,03                  |
| . FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER                                                                                                 |                 | 2.474,99     | 865.877,96            | 0,23                          | 0,23                  |
| . FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II                                                                                              |                 | 3.000,00     | 1.709.562,77          | 0,46                          | 0,46                  |
| . FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III                                                                                             |                 | 1.976,00     | 1.199.595,27          | 0,32                          | 0,32                  |
| . FIDC - BCSUL VERAX CPP 360                                                                                                       |                 | 984.095,86   | 1.017.610,48          | 0,27                          | 0,27                  |
| . FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I                                                                                         |                 | 1,00         | 100.278,04            | 0,03                          | 0,03                  |
| <u>Debêntures</u>                                                                                                                  |                 | 1.703.897    | 23.748.244,61         | 6,35                          |                       |
| . COMANCHE PART.                                                                                                                   |                 | 1.700.000    | 2.130.429,83          | 0,57                          | 0,57                  |
| . CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO                                                                                                   |                 | 22           | 10.794.722,17         | 2,89                          | 2,89                  |
| . CPFL ENERGIA                                                                                                                     |                 | 301          | 3.081.507,74          | 0,82                          | 0,82                  |
| . ELETROMETRÔ                                                                                                                      |                 | 3.074        | 1.482.661,14          | 0,40                          | 0,40                  |
| . ROTA DAS BANDEIRAS                                                                                                               |                 | 500          | 6.258.923,73          | 1,67                          | 1,67                  |
| <u>Outros Títulos</u>                                                                                                              |                 | 3.026        | 32.877.625,59         | 8,79                          |                       |
| . CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS                                                                                           |                 | 25           | 7.089.766,88          | 1,90                          | 1,90                  |
| . CERTIFICADO DE CEDULA DE CREDITO BANCARIO                                                                                        |                 | 1            | 20.951.772,72         | 5,60                          | 5,60                  |
| . DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL                                                                                           |                 | 3.000        | 4.749.935,59          | 1,27                          | 1,27                  |
| . VALORES A RECEBER                                                                                                                |                 |              | 86.150,40             | 0,02                          | 0,02                  |
| <b>B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL</b>                                                                                           |                 |              | <b>80.445.208,00</b>  | <b>21,52</b>                  |                       |
| <u>B1. Mercado de Ações</u>                                                                                                        |                 |              | 40.553.590,32         | 10,85                         |                       |
| <u>Companhias Abertas</u>                                                                                                          |                 | 3.298.479    | 33.548.938,98         | 8,97                          |                       |
| . ALL AMER LAT                                                                                                                     | ON              | 105.285      | 892.816,80            | 0,24                          |                       |
| . AMBEV                                                                                                                            | DIR             | 19           | 1.468,70              | 0,00                          |                       |
| . AMBEV                                                                                                                            | PN              | 7.780        | 601.394,00            | 0,16                          |                       |
| . BRF - BRASIL FOODS                                                                                                               | ON              | 65.454       | 1.989.147,06          | 0,53                          |                       |
| . BR MALLS PAR                                                                                                                     | ON              | 28.700       | 660.100,00            | 0,18                          |                       |
| . BVMF - BMF BOVESPA                                                                                                               | ON              | 140.700      | 1.442.175,00          | 0,39                          |                       |
| . COPEL                                                                                                                            | PNB             | 22.252       | 983.538,40            | 0,26                          |                       |
| . ECORODOVIAS                                                                                                                      | ON              | 25.900       | 418.803,00            | 0,11                          |                       |
| . ELETROBRÁS                                                                                                                       | ON              | 67.149       | 956.873,25            | 0,26                          |                       |

|                                                        |     |                     |                      |              |
|--------------------------------------------------------|-----|---------------------|----------------------|--------------|
| . GAFISA                                               | ON  | 57.100              | 150.173,00           | 0,04         |
| . GERDAU - GGBR                                        | PN  | 59.024              | 1.044.724,80         | 0,28         |
| . HYPERMARCAS                                          | ON  | 54.700              | 649.289,00           | 0,17         |
| . ISHARES                                              | CI  | 17.000              | 908.140,00           | 0,24         |
| . ITAUSA                                               | PN  | 307.203             | 2.611.225,50         | 0,70         |
| . LOCALIZA                                             | ON  | 15.500              | 470.425,00           | 0,13         |
| . MARCOPOLO                                            | PN  | 32.900              | 297.745,00           | 0,08         |
| . MARFRIG                                              | ON  | 60.900              | 568.806,00           | 0,15         |
| . OGX PETRÓLEO                                         | ON  | 135.100             | 743.050,00           | 0,20         |
| . PÃO DE AÇÚCAR                                        | PN  | 17.353              | 1.388.240,00         | 0,37         |
| . PDG REALT                                            | ON  | 355.954             | 1.249.398,54         | 0,33         |
| . PETROBRÁS                                            | PN  | 433.377             | 7.909.130,25         | 2,12         |
| . POSITIVO INF                                         | ON  | 38.300              | 215.629,00           | 0,06         |
| . RANDON PART                                          | PN  | 49.200              | 442.800,00           | 0,12         |
| . SID. NACIONAL - CSNA                                 | ON  | 57.038              | 649.092,44           | 0,17         |
| . SUZANO PAPEL                                         | PNA | 25.675              | 101.929,75           | 0,03         |
| . TELEF. BRASIL - VIVT                                 | PN  | 10.039              | 501.749,22           | 0,13         |
| . TIM PART S/A                                         | ON  | 20.160              | 224.985,60           | 0,06         |
| . TRACTEBEL                                            | ON  | 17.000              | 631.550,00           | 0,17         |
| . USIMINAS                                             | PNA | 121.900             | 770.408,00           | 0,21         |
| . V-AGRO                                               | ON  | 835.100             | 317.338,00           | 0,08         |
| . VALE R. DOCE                                         | ON  | 500                 | 20.065,00            | 0,01         |
| . VALE R. DOCE                                         | PNA | 114.217             | 4.472.737,72         | 1,20         |
| . DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER                           |     |                     | 157.247,22           | 0,04         |
| . VALORES A PAGAR ( - )                                |     |                     | -893.256,27          | -0,24        |
| <b>Instituições Financeiras</b>                        |     | <b>274.358</b>      | <b>7.004.651,34</b>  | <b>1,87</b>  |
| . BRADESCO                                             | PN  | 27.632              | 827.302,08           | 0,22         |
| . BRASIL                                               | ON  | 95.826              | 1.871.481,78         | 0,50         |
| . ITAUBANCO                                            | PN  | 150.900             | 4.268.961,00         | 1,14         |
| . DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER                           |     |                     | 36.906,48            | 0,01         |
| <b>B2. Mercado de Opções</b>                           |     | <b>-232.700</b>     | <b>-115.997,00</b>   | <b>-0,03</b> |
| . BMF BOVESPA                                          | ON  | -65.400             | -64.746,00           | -0,02        |
| . OGX PETRÓLEO                                         | ON  | -25.000             | -250,00              | 0,00         |
| . PDG REALT                                            | ON  | -82.700             | -42.177,00           | -0,01        |
| . PETROBRAS                                            | PN  | -59.600             | -8.824,00            | 0,00         |
| <b>B3. Fundos</b>                                      |     | <b>7.106.796,69</b> | <b>40.007.614,68</b> | <b>10,70</b> |
| . CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA                  |     | 555.194,69          | 5.361.888,75         | 1,43         |
| . FATOR SINERGIA                                       |     | 5.784,10            | 8.720.445,40         | 2,33         |
| . GERAÇÃO FUTURO                                       |     | 5.121.650,62        | 7.505.087,56         | 2,01         |
| . ITAU - UNIBANCO METRUS FIA                           |     | 103.844,36          | 9.764.993,34         | 2,61         |
| . M. SQUARE PIPE FIA                                   |     | 1.250.000,00        | 1.446.973,75         | 0,39         |
| . RB FUNDAMENTAL INST. FIA                             |     | 70.322,92           | 7.208.225,88         | 1,93         |
| <b>C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>                    |     | <b>82.283,32</b>    | <b>30.663.955,79</b> | <b>8,20</b>  |
| . FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES                     |     | 395,93              | 3.286.936,54         | 0,88         |
| . GOVERNANÇA E GESTÃO                                  |     | 10.745,39           | 3.218.413,95         | 0,86         |
| . P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP                      |     | 2.164,00            | 2.053.810,78         | 0,55         |
| . MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO                       |     | 10.000              | 1.749.799,86         | 0,47         |
| . ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO                           |     | 39.000              | 15.405.000,00        | 4,12         |
| . BRAZILIAN CAPITAL REAL ESTATE FUND. I FI IMOBILIARIO |     | 19.802              | 3.059.409,00         | 0,82         |
| . CLARITAS LOGÍSTICA I FI IMOBILIARIO                  |     | 176                 | 1.765.370,60         | 0,47         |
| . VALORES A RECEBER                                    |     |                     | 125.215,06           | 0,03         |
| <b>D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>                    |     |                     | <b>21.163.574,81</b> | <b>5,66</b>  |
| <b>D1 - Investimentos em Shopping Center</b>           |     |                     | <b>21.163.574,81</b> | <b>5,66</b>  |
| . SHOPPING METRÔ ITAQUERA                              |     |                     | 21.151.994,69        | 5,66         |
| . VALORES A RECEBER                                    |     |                     | 11.580,12            | 0,00         |
| <b>E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES</b>               |     | <b>2.175</b>        | <b>34.668.277,83</b> | <b>9,27</b>  |
| . OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES                          |     | 2.175               | 34.501.966,29        | 9,23         |
| . VALORES A PAGAR ( - )                                |     |                     | -49.713,14           | -0,01        |
| . VALORES A RECEBER                                    |     |                     | 216.024,68           | 0,06         |

|                          |  |  |                     |             |  |
|--------------------------|--|--|---------------------|-------------|--|
| <b>F - OUTROS</b>        |  |  | <b>1.413.841,09</b> | <b>0,38</b> |  |
| . DISPONIVEL             |  |  | 1.448.909,78        | 0,39        |  |
| . DEPOSITOS JUDICIAIS    |  |  | 96.648,89           | 0,03        |  |
| . OUTROS REALIZAVEIS     |  |  | 97.767,33           | 0,03        |  |
| . OUTRAS EXIGIBILIDADES  |  |  | -132.836,02         | -0,04       |  |
| . EXIGIVEL CONTINGENCIAL |  |  | -96.648,89          | -0,03       |  |

| <b>GESTÃO TERCEIRIZADA</b>                             | <b>Distribuição</b>  | <b>(%) em<br/>relação a<br/>Gestão<br/>Terceirizada</b> | <b>(%) em<br/>relação ao<br/>Recursos<br/>Garantidores</b> |
|--------------------------------------------------------|----------------------|---------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|
| <b>CARTEIRA</b>                                        |                      |                                                         |                                                            |
| - ITAU - UNIBANCO METRUS FIA                           | 9.764.993,34         | 10,96%                                                  | 2,61%                                                      |
| <b>FUNDOS</b>                                          |                      |                                                         |                                                            |
| - BRZ MUTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI         | 6.120.598,83         | 6,87%                                                   | 1,64%                                                      |
| - BTG PACTUAL                                          | 3.557.786,46         | 3,99%                                                   | 0,95%                                                      |
| - CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA                  | 5.361.888,75         | 6,02%                                                   | 1,43%                                                      |
| - FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER                     | 865.877,96           | 0,97%                                                   | 0,23%                                                      |
| - FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II                  | 1.709.562,77         | 1,92%                                                   | 0,46%                                                      |
| - FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III                 | 1.199.595,27         | 1,35%                                                   | 0,32%                                                      |
| - FIDC - BCSUL VERAX CPP 360                           | 1.017.610,48         | 1,14%                                                   | 0,27%                                                      |
| - FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I             | 100.278,04           | 0,11%                                                   | 0,03%                                                      |
| - SAFRA INSTITUCIONAL                                  | 3.850.461,94         | 4,32%                                                   | 1,03%                                                      |
| - FUNDO FATOR SINERGIA                                 | 8.720.445,40         | 9,79%                                                   | 2,33%                                                      |
| - GERAÇÃO FUTURO                                       | 7.505.087,56         | 8,42%                                                   | 2,01%                                                      |
| - M SQUARE PIPE FIA                                    | 1.446.973,75         | 1,62%                                                   | 0,39%                                                      |
| - RB FUNDAMENTAL INST. FIA                             | 7.208.225,88         | 8,09%                                                   | 1,93%                                                      |
| <b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>                      |                      |                                                         |                                                            |
| - GOVERNANÇA E GESTÃO                                  | 3.218.413,95         | 3,61%                                                   | 0,86%                                                      |
| - FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES                     | 3.286.936,54         | 3,69%                                                   | 0,88%                                                      |
| - P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP                      | 2.053.810,78         | 2,31%                                                   | 0,55%                                                      |
| - MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO                       | 1.761.799,86         | 1,98%                                                   | 0,47%                                                      |
| - ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO                           | 15.501.720,00        | 17,40%                                                  | 4,15%                                                      |
| - BRAZILIAN CAPITAL REAL ESTATE FUND. I FI IMOBILIARIO | 3.075.904,06         | 3,45%                                                   | 0,82%                                                      |
| - CLARITAS LOGÍSTICA I FI IMOBILIARIO                  | 1.765.370,60         | 1,98%                                                   | 0,47%                                                      |
| <b>TOTAL</b>                                           | <b>89.093.342,22</b> | <b>100,00%</b>                                          | <b>23,83%</b>                                              |

| <b>GESTÃO PRÓPRIA</b>                    | <b>Distribuição</b>   | <b>(%) em<br/>relação a<br/>Gestão<br/>Própria</b> | <b>(%) em<br/>relação ao<br/>Recursos<br/>Garantidores</b> |
|------------------------------------------|-----------------------|----------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|
| RENDA FIXA                               | 187.109.562,75        | 65,70%                                             | 50,04%                                                     |
| RENDA VARIÁVEL                           | 40.437.593,32         | 14,20%                                             | 10,82%                                                     |
| INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS               | 21.163.574,81         | 7,43%                                              | 5,66%                                                      |
| EMPRÉSTIMO PESSOAL                       | 34.668.277,83         | 12,17%                                             | 9,27%                                                      |
| OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis) | 1.413.841,09          | 0,50%                                              | 0,38%                                                      |
| <b>TOTAL</b>                             | <b>284.792.849,80</b> | <b>100,00%</b>                                     | <b>76,17%</b>                                              |