

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2010

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.117.421.323,28		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			759.465.586,52	67,97	
<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>		130.192	268.594.181,25	24,04	
<u>Letras Financeiras Tesouro</u>		10	12.745,00	0,00	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			275.628.095,19	24,67	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		143	200.787.977,05	17,97	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	5	33.257.267,29	2,98	2,98
. CDB 365 DIAS - BANIF	PÓS	4	16.057.732,73	1,44	1,44
. CDB 942 DIAS - BBM	PÓS	1	2.788.675,11	0,25	
. CDB 1170 DIAS - BBM	PÓS	1	7.330.662,16	0,66	0,91
. CDB 178 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	46.630,26	0,00	
. CDB 180 DIAS - BICBANCO	PÓS	2	556.739,76	0,05	
. CDB 181 DIAS - BICBANCO	PÓS	4	727.779,06	0,07	
. CDB 182 DIAS - BICBANCO	PÓS	3	524.945,42	0,05	
. CDB 183 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	1.002.393,21	0,09	
. CDB 185 DIAS - BICBANCO	PÓS	2	1.748.926,15	0,16	
. CDB 188 DIAS - BICBANCO	PÓS	2	2.096.431,95	0,19	
. CDB 192 DIAS - BICBANCO	PÓS	2	916.757,49	0,08	
. CDB 193 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	61.036,98	0,01	
. CDB 195 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	149.556,82	0,01	
. CDB 197 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	279.403,34	0,03	
. CDB 199 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	254.326,51	0,02	
. CDB 204 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	63.074,04	0,01	
. CDB 207 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	204.113,40	0,02	
. CDB 208 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	360.404,65	0,03	
. CDB 219 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	203.455,40	0,02	
. CDB 233 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	295.031,34	0,03	
. CDB 234 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	202.772,64	0,02	
. CDB 248 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	253.486,47	0,02	
. CDB 257 DIAS - BICBANCO	PÓS	2	2.943.099,91	0,26	
. CDB 262 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	202.805,70	0,02	
. CDB 276 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	101.411,12	0,01	
. CDB 297 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	152.134,05	0,01	
. CDB 304 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	202.853,65	0,02	
. CDB 311 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	189.675,91	0,02	
. CDB 315 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	1.080.723,25	0,10	1,33
. CDB 180 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	3	1.175.653,22	0,11	
. CDB 181 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	2	1.808.534,48	0,16	
. CDB 183 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	4	3.114.852,06	0,28	
. CDB 227 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	2	2.539.701,25	0,23	0,77
. CDB 180 DIAS - BVA	PÓS	1	6.226.751,78	0,56	
. CDB 182 DIAS - BVA	PÓS	2	1.217.612,13	0,11	0,67
. CDB 182 DIAS - CACIQUE	PÓS	2	40.028,16	0,00	0,00
. CDB 196 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	178.717,63	0,02	
. CDB 198 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	2	486.820,94	0,04	
. CDB 205 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	252.646,32	0,02	
. CDB 210 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	291.357,82	0,03	
. CDB 212 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	251.609,83	0,02	
. CDB 213 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	43.455,41	0,00	
. CDB 219 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	198.274,32	0,02	
. CDB 225 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	110.666,37	0,01	
. CDB 226 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	49.318,40	0,00	
. CDB 238 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	250.336,56	0,02	
. CDB 259 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	176.251,31	0,02	
. CDB 264 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	25.036,13	0,00	

. CDB 266 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	142.206,89	0,01	
. CDB 308 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.118.809,99	0,10	
. CDB 310 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	89.222,22	0,01	
. CDB 311 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	2	482.712,79	0,04	
. CDB 318 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	76.720,78	0,01	
. CDB 329 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	50.476,25	0,00	
. CDB 332 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	363.433,24	0,03	0,42
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	2	13.049.525,02	1,17	1,17
. CDB 180 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	4.645.584,95	0,42	
. CDB 182 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	2.029.436,63	0,18	0,60
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	2	13.447.496,91	1,20	
. CDB 1856 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	6.720.255,30	0,60	1,80
. CDB 187 DIAS - PANAMERICANO	PÓS	1	546.625,63	0,05	0,05
. CDB 180 DIAS - PINE	PÓS	1	826.560,50	0,07	
. CDB 181 DIAS - PINE	PÓS	1	500.570,39	0,04	
. CDB 182 DIAS - PINE	PÓS	2	3.267.068,48	0,29	
. CDB 185 DIAS - PINE	PÓS	2	1.625.641,06	0,15	
. CDB 192 DIAS - PINE	PÓS	1	158.124,84	0,01	
. CDB 197 DIAS - PINE	PÓS	1	272.861,84	0,02	
. CDB 198 DIAS - PINE	PÓS	1	861.164,40	0,08	
. CDB 207 DIAS - PINE	PÓS	1	698.484,38	0,06	
. CDB 212 DIAS - PINE	PÓS	1	203.022,32	0,02	
. CDB 223 DIAS - PINE	PÓS	1	60.902,45	0,01	
. CDB 225 DIAS - PINE	PÓS	1	203.004,13	0,02	0,78
. CDB 3536 DIAS - PROSPER	PÓS	1	5.672.777,28	0,51	
. CDB 3652 DIAS - PROSPER	PÓS	1	5.671.230,73	0,51	1,02
. CDB 180 DIAS - SCHAHIN	PÓS	3	2.423.166,98	0,22	
. CDB 182 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	1.980.458,89	0,18	
. CDB 184 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	454.968,34	0,04	
. CDB 186 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	489.834,53	0,04	
. CDB 190 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	236.039,67	0,02	
. CDB 192 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	215.703,94	0,02	
. CDB 205 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	2.388.939,89	0,21	
. CDB 257 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	2.943.919,67	0,26	
. CDB 315 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	1.081.523,60	0,10	
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	8.675.069,30	0,78	1,87
. CDB 173 DIAS - SOFISA	PÓS	1	1.025.102,93	0,09	
. CDB 182 DIAS - SOFISA	PÓS	1	2.652.143,87	0,24	
. CDB 183 DIAS - SOFISA	PÓS	1	54.934,96	0,00	
. CDB 185 DIAS - SOFISA	PÓS	1	1.455.654,02	0,13	
. CDB 189 DIAS - SOFISA	PÓS	1	853.212,77	0,08	
. CDB 190 DIAS - SOFISA	PÓS	2	2.162.137,14	0,19	
. CDB 195 DIAS - SOFISA	PÓS	1	469.746,40	0,04	
. CDB 208 DIAS - SOFISA	PÓS	2	266.005,58	0,02	
. CDB 227 DIAS - SOFISA	PÓS	2	2.439.849,50	0,22	
. CDB 239 DIAS - SOFISA	PÓS	1	88.568,09	0,01	
. CDB 252 DIAS - SOFISA	PÓS	3	351.665,84	0,03	
. CDB 257 DIAS - SOFISA	PÓS	2	2.947.644,81	0,26	
. CDB 315 DIAS - SOFISA	PÓS	1	1.083.328,73	0,10	1,42
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	2	8.572.508,31	0,77	0,77
Letra Financeira Subordinada		16,00	5.062.851,99	0,45	
. PINE		16,00	5.062.851,99	0,45	
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		11.865.273,44	69.777.266,15	6,24	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	40.618,31	0,00	0,00
. BRADESCO DI FIF ASSISTENCIAL		8.013.040,71	26.384.131,12	2,36	2,36
. REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		11,56	8.863,78	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		3.818.568,95	5.093.762,11	0,46	0,46
. BNP PARIBAS SMART		214,85	1.441,23	0,00	0,00
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,15	5.057.637,30	0,45	0,45
. FIDC COMANCHE		50,00	5.056.832,91	0,45	0,45
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		4.467,00	4.211.236,54	0,38	0,38
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER		8.673,99	8.085.840,13	0,72	0,72
. FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II		14.999,99	15.836.902,72	1,42	1,42
Debêntures		13.609	27.927.252,28	2,50	
. CPFL ENERGIA		1.101	11.133.251,38	1,00	1,00
. ELETROMETRÔ		10.248	7.347.806,53	0,66	0,66
. PETROBRÁS		1.760	3.742.843,93	0,33	0,33
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	5.703.350,44	0,51	0,51
				0,00	0,00

<u>Outros Títulos</u>		<u>5.074</u>	<u>187.303.312,80</u>	<u>16,76</u>	
. Certificado de Recebíveis Imobiliários		52	19.768.416,36	1,77	1,77
. Cédula de Crédito Bancário		19	44.302.808,49	3,96	3,96
. Certificado de Cédula de Créd. Bancário		3	116.918.798,42	10,46	10,46
. Depósito a Prazo com Garantia Especial		5.000	6.313.289,53	0,56	0,56
<u>B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL</u>			<u>208.066.302,41</u>	<u>18,61</u>	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			<u>102.335.344,42</u>	<u>9,15</u>	
<u>Companhias Abertas</u>		<u>4.871.214</u>	<u>84.143.495,89</u>	<u>7,53</u>	
. ALL AMER LAT	ON	79.978	1.199.670,00	0,11	
. AMBEV	PN	70.040	3.538.420,80	0,32	
. BRADESCAR	PN	17.700	766.764,00	0,07	
. BRASIL ECODESEL	ON	437.500	437.500,00	0,04	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	115.550	3.159.137,00	0,28	
. BR MALLS PAR	ON	50.500	863.550,00	0,08	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	367.600	4.826.588,00	0,43	
. CEMIG	PN	25.885	691.388,35	0,06	
. CESP	PNB	36.000	972.000,00	0,09	
. CONFAB	PN	30.023	183.140,30	0,02	
. COPEL	PNB	27.870	1.156.605,00	0,10	
. DURATEX	ON	26.000	464.100,00	0,04	
. ECORODOVIAS	ON	36.000	460.080,00	0,04	
. ELETROBRÁS	ON	38.277	851.280,48	0,08	
. GERAÇÃO TIETÊ	PN	21.700	520.800,00	0,05	
. GERDAU - GGBR	PN	43.378	983.379,26	0,09	
. HYPERMARCAS	ON	39.500	889.935,00	0,08	
. ITAUSA	PN	259.289	3.422.614,80	0,31	
. LOJAS AMERICANAS	PN	48.600	744.066,00	0,07	
. MARFRIG	ON	79.200	1.227.600,00	0,11	
. MILLS	ON	20.800	428.480,00	0,04	
. NATURA	ON	15.900	758.271,00	0,07	
. OHL BRASIL	ON	9.200	551.908,00	0,05	
. PÃO DE AÇUCAR	PNA	31.581	2.188.563,30	0,20	
. PDG REALT	ON	255.734	2.598.257,44	0,23	
. PETROBRÁS	ON	262.941	8.032.847,55	0,72	
. PETROBRÁS	PN	401.159	10.947.629,11	0,98	
. POSITIVO INF	ON	42.100	410.475,00	0,04	
. RANDON PART	PN	57.350	704.831,50	0,06	
. REDECARD - RDGD	ON	53.400	1.124.070,00	0,10	
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	84.042	2.241.400,14	0,20	
. SUZANO PAPEL	PNA	27.450	405.711,00	0,04	
. TAIFE	ON	1.300.000	8.723.000,00	0,78	
. TELEMAR - TNLP	PN	17.091	415.140,39	0,04	
. TIM PART S/A	PN	73.600	405.536,00	0,04	
. TRECTEBEL	ON	27.200	746.640,00	0,07	
. USIMINAS	PNA	53.724	1.029.351,84	0,09	
. VALE R. DOCE	ON	84.563	4.678.870,79	0,42	
. VALE R. DOCE	PNA	178.560	8.660.160,00	0,78	
. VIVO - VIVO4	PN	24.229	1.291.405,70	0,12	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			442.328,14	0,04	
<u>Instituições Financeiras</u>		<u>510.831</u>	<u>18.191.848,53</u>	<u>1,62</u>	
. BRADESCO	DIR	2.615	22.462,85	0,00	
. BRADESCO	PN	157.898	5.155.369,70	0,46	
. BRASIL	ON	122.052	3.834.873,84	0,34	
. ITAU	PN	228.266	9.082.704,14	0,81	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			96.438,00	0,01	
<u>B2. Mercado de Opções</u>		<u>798.700</u>	<u>18.777.437,00</u>	<u>1,68</u>	
. PETROBRÁS	PN	798.700	18.777.437,00	1,68	
<u>B3. Fundos</u>		<u>10.061.578,19</u>	<u>86.953.520,99</u>	<u>7,78</u>	
. SCHRODERS FIA EXCLUSIVO		492.959,72	56.074.707,18	5,02	
. FATOR SINERGIA		8.342,00	11.660.396,65	1,04	
. GERAÇÃO FUTURO		8.934.666,77	15.842.363,23	1,42	
. RB FUNDAMENTAL		625.609,70	3.376.053,93	0,30	
<u>C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</u>		<u>66.104,89</u>	<u>37.097.740,70</u>	<u>3,33</u>	
. GOVERNANÇA E GESTÃO		10.500,03	5.170.758,74	0,46	
. GOVERNANÇA E GESTÃO II		6.050,54	5.481.598,33	0,49	

. FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES		554,32	3.457.573,72	0,31
. MEMORIAL OFFICE		10.000	1.204.999,91	0,11
. ÁGUA BRANCA		39.000	11.700.000,00	1,05
. BRAZILIAN CAPITAL		99.010	10.000.010,00	0,89
. Valores a receber			82.800,00	0,01
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			52.194.254,94	4,67
D1 - Investimentos em Shopping Center			40.709.020,39	3,64
Shopping Tatuapé II			11.669.333,34	1,04
Shopping Plaza Sul			20.647.843,49	1,85
Shopping Metrô Itaquera			7.885.121,81	0,71
. Valores a receber			506.721,75	0,05
D2 - Investimento Imobiliário			11.485.234,55	1,03
. PANAMBY			12.441.286,84	1,11
. Valores a pagar (-)			-956.052,29	-0,09
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		4.130	59.817.130,84	5,35
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		4.130	59.403.971,58	5,32
. VALORES A PAGAR (-)			-92.274,34	-0,01
. VALORES A RECEBER			505.433,60	0,05
F - OUTROS			780.307,87	0,07
. Disponíveis			780.307,87	0,07

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- SCHRODERS FIA EXCLUSIVO	56.074.707,18	28,93%	5,02%
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	40.618,31	0,02%	0,00%
- BNP PARIBAS SMART	1.441,23	0,00%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA	11.660.396,65	6,02%	1,04%
- GERAÇÃO FUTURO	15.842.363,23	8,17%	1,42%
- RB.FUNDAMENTAL	3.376.053,93	1,74%	0,30%
- FIDC COMANCHE	5.056.832,91	2,61%	0,45%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	4.211.236,54	2,17%	0,38%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	8.085.840,13	4,17%	0,72%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	15.836.902,72	8,17%	1,42%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS CP FIC DE FI	5.057.637,30	2,61%	0,45%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	8.863,78	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	5.093.762,11	2,63%	0,46%
FUNDO EXCLUSIVO			
- METRUS DI FIF BRAM - ASSISTENCIAL	26.384.131,12	13,61%	2,36%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO	5.170.758,74	2,67%	0,46%
- GOVERNANÇA E GESTÃO II	5.481.598,33	2,83%	0,49%
- FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES	3.457.573,72	1,78%	0,31%
- MEMORIAL OFFICE	1.209.799,91	0,62%	0,11%
- ÁGUA BRANCA	11.778.000,00	6,08%	1,05%
- BRAZILIAN CAPITAL	10.000.010,00	5,16%	0,89%
TOTAL	193.828.527,84	100,00%	17,35%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	689.688.320,37	74,67%	61,72%
RENDA VARIÁVEL	121.112.781,42	13,11%	10,84%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	52.194.254,94	5,65%	4,67%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	59.817.130,84	6,48%	5,35%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	780.307,87	0,08%	0,07%
TOTAL	923.592.795,44	100,00%	82,65%