

## RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

## PLANO I

## POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2010

| DISCRIMINAÇÃO                                                                                                                      | Espécie<br>Tipo | Quantidade | Valor em R\$   | Alocação do<br>patrimônio (%) | Diversificação<br>(%) |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|------------|----------------|-------------------------------|-----------------------|
| INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO                                                                                                    |                 |            | 715.822.075,82 |                               |                       |
| A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA                                                                                                    |                 |            | 506.928.280,32 | 70,82                         |                       |
| <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>                                                                                                    |                 | 119.429    | 250.790.414,07 | 35,04                         |                       |
| <u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>                                                                                      |                 |            | 120.250.892,74 | 16,80                         |                       |
| <u>Certificado de Depósito Bancário</u>                                                                                            |                 | 69         | 97.564.160,67  | 13,63                         |                       |
| . CDB 1.826 DIAS - ABC                                                                                                             | PÓS             | 1          | 6.574.130,93   | 0,92                          | 0,92                  |
| . CDB 365 DIAS - BANIF                                                                                                             | PÓS             | 1          | 3.380.248,87   | 0,47                          | 0,47                  |
| . CDB 180 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 2          | 556.739,76     | 0,08                          |                       |
| . CDB 181 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 2          | 450.263,06     | 0,06                          |                       |
| . CDB 182 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 76.466,54      | 0,01                          |                       |
| . CDB 185 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 2          | 1.748.926,15   | 0,24                          |                       |
| . CDB 188 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 1.312.199,67   | 0,18                          |                       |
| . CDB 192 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 254.319,31     | 0,04                          |                       |
| . CDB 193 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 61.036,98      | 0,01                          |                       |
| . CDB 195 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 149.556,82     | 0,02                          |                       |
| . CDB 199 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 254.326,51     | 0,04                          |                       |
| . CDB 204 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 63.074,04      | 0,01                          |                       |
| . CDB 219 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 203.455,40     | 0,03                          |                       |
| . CDB 233 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 295.031,34     | 0,04                          |                       |
| . CDB 234 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 202.772,64     | 0,03                          |                       |
| . CDB 248 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 253.486,47     | 0,04                          |                       |
| . CDB 257 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 2.366.658,27   | 0,33                          |                       |
| . CDB 262 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 202.805,70     | 0,03                          |                       |
| . CDB 276 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 101.411,12     | 0,01                          |                       |
| . CDB 297 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 152.134,05     | 0,02                          |                       |
| . CDB 304 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 202.853,65     | 0,03                          |                       |
| . CDB 311 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 189.675,91     | 0,03                          |                       |
| . CDB 315 DIAS - BICBANCO                                                                                                          | PÓS             | 1          | 1.080.723,25   | 0,15                          | 1,42                  |
| . CDB 180 DIAS - BONSUCESSO                                                                                                        | PÓS             | 1          | 71.190,38      | 0,01                          |                       |
| . CDB 183 DIAS - BONSUCESSO                                                                                                        | PÓS             | 2          | 2.777.822,23   | 0,39                          |                       |
| . CDB 227 DIAS - BONSUCESSO                                                                                                        | PÓS             | 1          | 2.031.761,00   | 0,28                          | 0,68                  |
| . CDB 180 DIAS - BVA                                                                                                               | PÓS             | 1          | 6.226.751,78   | 0,87                          |                       |
| . CDB 182 DIAS - BVA                                                                                                               | PÓS             | 2          | 1.217.612,13   | 0,17                          | 1,04                  |
| . CDB 308 DIAS - DAYCOVAL                                                                                                          | PÓS             | 1          | 1.118.809,99   | 0,16                          |                       |
| . CDB 310 DIAS - DAYCOVAL                                                                                                          | PÓS             | 1          | 89.222,22      | 0,01                          |                       |
| . CDB 311 DIAS - DAYCOVAL                                                                                                          | PÓS             | 2          | 482.712,79     | 0,07                          |                       |
| . CDB 318 DIAS - DAYCOVAL                                                                                                          | PÓS             | 1          | 76.720,78      | 0,01                          |                       |
| . CDB 329 DIAS - DAYCOVAL                                                                                                          | PÓS             | 1          | 50.476,25      | 0,01                          |                       |
| . CDB 332 DIAS - DAYCOVAL                                                                                                          | PÓS             | 1          | 363.433,24     | 0,05                          | 0,30                  |
| . CDB 1826 DIAS - FIBRA                                                                                                            | PÓS             | 1          | 8.029.653,37   | 1,12                          | 1,12                  |
| . CDB 180 DIAS - INDUSVAL                                                                                                          | PÓS             | 1          | 4.645.584,95   | 0,65                          |                       |
| . CDB 182 DIAS - INDUSVAL                                                                                                          | PÓS             | 1          | 2.029.436,63   | 0,28                          | 0,93                  |
| . CDB 1653 DIAS - ITAÚ                                                                                                             | PÓS             | 1          | 9.413.773,44   | 1,32                          | 1,32                  |
| . CDB 182 DIAS - PINE                                                                                                              | PÓS             | 1          | 1.875.272,17   | 0,26                          |                       |
| . CDB 185 DIAS - PINE                                                                                                              | PÓS             | 1          | 1.451.956,45   | 0,20                          |                       |
| . CDB 197 DIAS - PINE                                                                                                              | PÓS             | 1          | 272.861,84     | 0,04                          |                       |
| . CDB 207 DIAS - PINE                                                                                                              | PÓS             | 1          | 698.484,38     | 0,10                          |                       |
| . CDB 212 DIAS - PINE                                                                                                              | PÓS             | 1          | 203.022,32     | 0,03                          |                       |
| . CDB 223 DIAS - PINE                                                                                                              | PÓS             | 1          | 60.902,45      | 0,01                          |                       |
| . CDB 225 DIAS - PINE                                                                                                              | PÓS             | 1          | 203.004,13     | 0,03                          | 0,67                  |
| . CDB 3536 DIAS - PROSPER                                                                                                          | PÓS             | 1          | 5.672.777,28   | 0,79                          | 0,79                  |
| . CDB 180 DIAS - SCHAHIN                                                                                                           | PÓS             | 2          | 1.872.489,21   | 0,26                          |                       |
| . CDB 182 DIAS - SCHAHIN                                                                                                           | PÓS             | 1          | 1.876.224,21   | 0,26                          |                       |
| . CDB 186 DIAS - SCHAHIN                                                                                                           | PÓS             | 1          | 489.834,53     | 0,07                          |                       |
| . CDB 205 DIAS - SCHAHIN                                                                                                           | PÓS             | 1          | 2.388.939,89   | 0,33                          |                       |
| . CDB 257 DIAS - SCHAHIN                                                                                                           | PÓS             | 1          | 2.367.317,47   | 0,33                          |                       |

|                                                       |     |                  |                       |              |      |
|-------------------------------------------------------|-----|------------------|-----------------------|--------------|------|
| . CDB 315 DIAS - SCHAHIN                              | PÓS | 1                | 1.081.523,60          | 0,15         | 1,41 |
| . CDB 173 DIAS - SOFISA                               | PÓS | 1                | 1.025.102,93          | 0,14         |      |
| . CDB 182 DIAS - SOFISA                               | PÓS | 1                | 2.652.143,87          | 0,37         |      |
| . CDB 185 DIAS - SOFISA                               | PÓS | 1                | 1.455.654,02          | 0,20         |      |
| . CDB 208 DIAS - SOFISA                               | PÓS | 1                | 212.599,05            | 0,03         |      |
| . CDB 227 DIAS - SOFISA                               | PÓS | 1                | 2.033.207,92          | 0,28         |      |
| . CDB 239 DIAS - SOFISA                               | PÓS | 1                | 88.568,09             | 0,01         |      |
| . CDB 252 DIAS - SOFISA                               | PÓS | 1                | 227.179,37            | 0,03         |      |
| . CDB 257 DIAS - SOFISA                               | PÓS | 1                | 2.370.313,00          | 0,33         |      |
| . CDB 315 DIAS - SOFISA                               | PÓS | 1                | 1.083.328,73          | 0,15         | 1,56 |
| . CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM                          | PÓS | 1                | 7.144.196,14          | 1,00         | 1,00 |
| <b>Letra Financeira Subordinada</b>                   |     | <u>16,00</u>     | <u>5.062.851,99</u>   | <u>0,71</u>  |      |
| . PINE                                                |     | 16,00            | 5.062.851,99          | 0,71         | 0,71 |
| <b>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</b> |     | <u>15.937,09</u> | <u>17.623.880,08</u>  | <u>2,46</u>  |      |
| . ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM                      |     | 516,24           | 40.618,31             | 0,01         | 0,01 |
| . BNP PARIBAS SMART                                   |     | 214,85           | 1.441,23              | 0,00         | 0,00 |
| . FIDC COMANCHE                                       |     | 25,00            | 2.528.416,46          | 0,35         | 0,35 |
| . FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA      |     | 3.467,00         | 3.268.492,74          | 0,46         | 0,46 |
| . FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER                     |     | 4.714,00         | 4.394.356,73          | 0,61         | 0,61 |
| . FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II                  |     | 7.000,00         | 7.390.554,61          | 1,03         | 1,03 |
| <b>Debêntures</b>                                     |     | <u>12.808</u>    | <u>16.976.151,25</u>  | <u>2,37</u>  |      |
| . CPFL ENERGIA                                        |     | 800              | 8.089.555,95          | 1,13         | 1,13 |
| . ELETROMETRÔ                                         |     | 10.248           | 5.143.751,37          | 0,72         | 0,72 |
| . PETROBRÁS                                           |     | 1.760            | 3.742.843,93          | 0,52         | 0,52 |
| <b>Outros Títulos</b>                                 |     | <u>52</u>        | <u>118.910.822,26</u> | <u>16,61</u> |      |
| . Certificado de Recebíveis Imobiliários              |     | 34               | 14.127.822,63         | 1,97         | 1,97 |
| . Cédula de Crédito Bancário                          |     | 17               | 33.923.106,13         | 4,74         | 4,74 |
| . Certificado de Cédula de Créd. Bancário             |     | 1                | 70.859.893,50         | 9,90         | 9,90 |
| <b>B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL</b>              |     |                  | <b>115.722.457,91</b> | <b>16,16</b> |      |
| <b>B1. Mercado de Ações</b>                           |     |                  | <u>55.792.055,24</u>  | <u>7,79</u>  |      |
| <b>Companhias Abertas</b>                             |     | <u>3.091.552</u> | <u>46.674.725,58</u>  | <u>6,52</u>  |      |
| . ALL AMER LAT                                        | ON  | 40.066           | 600.990,00            | 0,08         |      |
| . AMBEV                                               | PN  | 37.540           | 1.896.520,80          | 0,26         |      |
| . BRADESCAR                                           | PN  | 8.900            | 385.548,00            | 0,05         |      |
| . BRASIL ECDIESEL                                     | ON  | 218.000          | 218.000,00            | 0,03         |      |
| . BRF - BRASIL FOODS                                  | ON  | 57.924           | 1.583.642,16          | 0,22         |      |
| . BR MALLS PAR                                        | ON  | 25.300           | 432.630,00            | 0,06         |      |
| . BVMF - BMF BOVESPA                                  | ON  | 184.000          | 2.415.920,00          | 0,34         |      |
| . CEMIG                                               | PN  | 12.945           | 345.760,95            | 0,05         |      |
| . CESP                                                | PNB | 18.100           | 488.700,00            | 0,07         |      |
| . CONFAB                                              | PN  | 15.020           | 91.622,00             | 0,01         |      |
| . COPEL                                               | PNB | 14.073           | 584.029,50            | 0,08         |      |
| . DURATEX                                             | ON  | 13.000           | 232.050,00            | 0,03         |      |
| . ECORODOVIAS                                         | ON  | 18.000           | 230.040,00            | 0,03         |      |
| . ELETROBRÁS                                          | ON  | 19.188           | 426.741,12            | 0,06         |      |
| . GERAÇÃO TIETÊ                                       | PN  | 10.900           | 261.600,00            | 0,04         |      |
| . GERDAU - GGBR                                       | PN  | 21.764           | 493.389,88            | 0,07         |      |
| . HYPERMARCAS                                         | ON  | 19.800           | 446.094,00            | 0,06         |      |
| . ITAUSA                                              | PN  | 129.884          | 1.714.468,80          | 0,24         |      |
| . LOJAS AMERICANAS                                    | PN  | 24.300           | 372.033,00            | 0,05         |      |
| . MARFRIG                                             | ON  | 39.700           | 615.350,00            | 0,09         |      |
| . MILLS                                               | ON  | 10.500           | 216.300,00            | 0,03         |      |
| . NATURA                                              | ON  | 8.000            | 381.520,00            | 0,05         |      |
| . OHL BRASIL                                          | ON  | 4.600            | 275.954,00            | 0,04         |      |
| . PÃO DE AÇUCAR                                       | PNA | 15.909           | 1.102.493,70          | 0,15         |      |
| . PDG REALT                                           | ON  | 128.292          | 1.303.446,72          | 0,18         |      |
| . PETROBRÁS                                           | ON  | 131.941          | 4.030.797,55          | 0,56         |      |
| . PETROBRÁS                                           | PN  | 201.417          | 5.496.669,93          | 0,77         |      |
| . POSITIVO INF                                        | ON  | 21.100           | 205.725,00            | 0,03         |      |
| . RANDON PART                                         | PN  | 28.800           | 353.952,00            | 0,05         |      |
| . REDECARD - RDGD                                     | ON  | 26.800           | 564.140,00            | 0,08         |      |
| . SID. NACIONAL - CSNA                                | ON  | 42.108           | 1.123.020,36          | 0,16         |      |
| . SUZANO PAPEL                                        | PNA | 13.700           | 202.486,00            | 0,03         |      |
| . TAIFE                                               | ON  | 1.300.000        | 8.723.000,00          | 1,22         |      |
| . TELEMAR - TNLN                                      | PN  | 8.563            | 207.995,27            | 0,03         |      |
| . TIM PART S/A                                        | PN  | 36.900           | 203.319,00            | 0,03         |      |

|                                              |     |                     |                      |             |
|----------------------------------------------|-----|---------------------|----------------------|-------------|
| . TRECTEBEL                                  | ON  | 13.600              | 373.320,00           | 0,05        |
| . USIMINAS                                   | PNA | 26.958              | 516.515,28           | 0,07        |
| . VALE R. DOCE                               | ON  | 42.356              | 2.343.557,48         | 0,33        |
| . VALE R. DOCE                               | PNA | 89.427              | 4.337.209,50         | 0,61        |
| . VIVO - VIVO4                               | PN  | 12.177              | 649.034,10           | 0,09        |
| . DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER                 |     |                     | 229.139,48           | 0,03        |
| <b>Instituições Financeiras</b>              |     | <b>255.994</b>      | <b>9.117.329,66</b>  | <b>1,27</b> |
| . BRADESCO                                   | DIR | 1.311               | 11.261,49            | 0,00        |
| . BRADESCO                                   | PN  | 79.147              | 2.584.149,55         | 0,36        |
| . BRASIL                                     | ON  | 61.147              | 1.921.238,74         | 0,27        |
| . ITAU                                       | PN  | 114.389             | 4.551.538,31         | 0,64        |
| . DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER                 |     |                     | 49.141,57            | 0,01        |
| <b>B2. Mercado de Opções</b>                 |     | <b>346.300</b>      | <b>8.141.513,00</b>  | <b>1,14</b> |
| . PETROBRÁS                                  | PN  | 346.300             | 8.141.513,00         | 1,14        |
| <b>B3. Fundos</b>                            |     | <b>3.954.595,70</b> | <b>51.788.889,67</b> | <b>7,23</b> |
| . SCHRODERS FIA EXCLUSIVO                    |     | 346.969,65          | 39.468.177,84        | 5,51        |
| . FATOR SINERGIA                             |     | 3.202,00            | 4.475.736,04         | 0,63        |
| . GERAÇÃO FUTURO                             |     | 3.203.172,95        | 5.679.655,52         | 0,79        |
| . RB FUNDAMENTAL                             |     | 401.251,10          | 2.165.320,27         | 0,30        |
| <b>C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>          |     | <b>6.473,97</b>     | <b>16.122.808,48</b> | <b>2,26</b> |
| . GOVERNANÇA E GESTÃO II                     |     | 6.050,54            | 5.481.598,33         | 0,77        |
| . FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES             |     | 423,43              | 2.641.202,15         | 0,37        |
| . BRAZILIAN CAPITAL                          |     | 79.208              | 8.000.008,00         | 1,12        |
| . Valores a receber                          |     |                     |                      | 0,00        |
| <b>D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>          |     |                     | <b>44.309.133,13</b> | <b>6,19</b> |
| <b>D1 - Investimentos em Shopping Center</b> |     |                     | <b>32.823.898,58</b> | <b>4,59</b> |
| . Shopping Tatuapé II                        |     |                     | 11.669.333,34        | 1,63        |
| . Shopping Plaza Sul                         |     |                     | 20.647.843,49        | 2,88        |
| . Valores a receber                          |     |                     | 506.721,75           | 0,07        |
| <b>D2 - Investimento Imobiliário</b>         |     |                     | <b>11.485.234,55</b> | <b>1,60</b> |
| . PANAMBY                                    |     |                     | 12.441.286,84        | 1,74        |
| . Valores a pagar (-)                        |     |                     | -956.052,29          | -0,13       |
| <b>E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES</b>     |     | <b>2.307</b>        | <b>32.221.346,67</b> | <b>4,50</b> |
| . OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES                |     | 2.307               | 32.062.157,74        | 4,48        |
| . VALORES A PAGAR (-)                        |     |                     | -76.293,67           | -0,01       |
| . VALORES A RECEBER                          |     |                     | 235.482,60           | 0,03        |
| <b>F - OUTROS</b>                            |     |                     | <b>518.049,31</b>    | <b>0,07</b> |
| . Disponíveis                                |     |                     | 102.037,45           | 0,01        |
| . Outras Exigibilidades                      |     |                     | 416.011,86           | 0,06        |

| GESTÃO TERCEIRIZADA                             | Distribuição  | (%) em<br>relação a<br>Gestão<br>Terceirizada | (%) em<br>relação ao<br>Recursos<br>Garantidores |
|-------------------------------------------------|---------------|-----------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| <b>CARTEIRA</b>                                 |               |                                               |                                                  |
| - SCHRODERS FIA EXCLUSIVO                       | 39.468.177,84 | 46,14%                                        | 5,51%                                            |
| <b>FUNDOS</b>                                   |               |                                               |                                                  |
| - ABN FIC REF. DI. PROFIT PREMIUM               | 40.618,31     | 0,05%                                         | 0,01%                                            |
| - BNP PARIBAS SMART                             | 1.441,23      | 0,00%                                         | 0,00%                                            |
| - FIDC COMANCHE                                 | 2.528.416,46  | 2,96%                                         | 0,35%                                            |
| - FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST ENERGIA ELETRICA | 3.268.492,74  | 3,82%                                         | 0,46%                                            |
| - FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER              | 4.394.356,73  | 5,14%                                         | 0,61%                                            |
| - FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II           | 7.390.554,61  | 8,64%                                         | 1,03%                                            |
| - FUNDO FATOR SINERGIA                          | 4.475.736,04  | 5,23%                                         | 0,63%                                            |
| - GERAÇÃO FUTURO                                | 5.679.655,52  | 6,64%                                         | 0,79%                                            |
| - RB.FUNDAMENTAL                                | 2.165.320,27  | 2,53%                                         | 0,30%                                            |

|                                   |                      |                |               |
|-----------------------------------|----------------------|----------------|---------------|
| <b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b> |                      |                |               |
| - GOVERNANÇA E GESTÃO II          | 5.481.598,33         | 6,41%          | 0,77%         |
| - FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES  | 2.641.202,15         | 3,09%          | 0,37%         |
| - BRAZILIAN CAPITAL               | 8.000.008,00         | 9,35%          | 1,12%         |
| <b>TOTAL</b>                      | <b>85.535.578,23</b> | <b>100,00%</b> | <b>11,95%</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> |
|------------------------------------------|-----------------------|----------------------------------------------------|------------------------------------------------------------|
| RENTA FIXA                               | 489.304.400,24        | 77,63%                                             | 68,36%                                                     |
| RENTA VARIÁVEL                           | 63.933.568,24         | 10,14%                                             | 8,93%                                                      |
| INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS               | 44.309.133,13         | 7,03%                                              | 6,19%                                                      |
| EMPRÉSTIMO PESSOAL                       | 32.221.346,67         | 5,11%                                              | 4,50%                                                      |
| OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis) | 518.049,31            | 0,08%                                              | 0,07%                                                      |
| <b>TOTAL</b>                             | <b>630.286.497,59</b> | <b>100,00%</b>                                     | <b>88,05%</b>                                              |