

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2011

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			1.255.416.280,47		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			848.819.501,49	67,61	
<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>		158.553	362.515.187,64	28,88	
<u>Letras Financeiras Tesouro</u>		10	50.198,14	0,00	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			238.066.367,52	18,96	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		54,00	139.102.194,69	11,08	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	5	38.619.789,68	3,08	3,08
. CDB 1170 DIAS - BBM	PÓS	1	8.458.561,52	0,67	0,67
. CDB 1827 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	753.467,98	0,06	0,06
. CDB 381 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	1.204.905,92	0,10	
. CDB 444 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	1.335.763,87	0,11	
. CDB 472 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	299.829,36	0,02	
. CDB 473 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	123.348,43	0,01	
. CDB 475 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	246.939,12	0,02	0,26
. CDB 180 DIAS - BVA	PÓS	3	808.810,79	0,06	0,06
. CDB 180 DIAS - CACIQUE	PÓS	1	31.357,23	0,00	
. CDB 182 DIAS - CACIQUE	PÓS	1	13.432,79	0,00	0,00
. CDB 367 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	225.073,69	0,02	
. CDB 386 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.412.423,11	0,11	
. CDB 388 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.190.300,40	0,09	
. CDB 389 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	443.464,45	0,04	0,26
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	2	15.098.354,16	1,20	1,20
. CDB 381 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	1.202.171,53	0,10	
. CDB 395 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	117.496,26	0,01	
. CDB 410 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	55.960,98	0,00	
. CDB 414 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	2.406.396,09	0,19	
. CDB 441 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	55.977,32	0,00	
. CDB 444 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	1.298.710,04	0,10	
. CDB 475 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	246.259,83	0,02	0,43
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	2	15.334.743,66	1,22	
. CDB 1856 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	7.799.371,46	0,62	1,84
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.601.499,65	0,45	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.579.451,08	0,44	0,89
. CDB 364 DIAS - PINE	PÓS	1	55.918,39	0,00	
. CDB 366 DIAS - PINE	PÓS	1	782.861,41	0,06	
. CDB 379 DIAS - PINE	PÓS	1	211.132,19	0,02	
. CDB 380 DIAS - PINE	PÓS	1	117.431,97	0,01	
. CDB 387 DIAS - PINE	PÓS	1	223.681,42	0,02	
. CDB 394 DIAS - PINE	PÓS	1	55.920,94	0,00	
. CDB 395 DIAS - PINE	PÓS	1	347.828,95	0,03	0,14
. CDB 3536 DIAS - PROSPER	PÓS	1	5.988.662,24	0,48	
. CDB 3652 DIAS - PROSPER	PÓS	1	5.988.792,51	0,48	0,95
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	10.147.873,15	0,81	
. CDB 1827 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	697.705,08	0,06	0,86
. CDB 358 DIAS - SOFISA	PÓS	1	2.427.174,04	0,19	
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	3.394.530,05	0,27	0,46
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	2	9.879.772,68	0,79	0,79
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS			-11.180.950,73	-0,89	-0,89
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		35	12.428.761,41	0,99	
. PINE		17	5.924.413,91	0,47	0,47

. ABC		17	5.991.172,89	0,48	0,48
. BONSUCESSO		1	513.174,61	0,04	0,04
Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.		12.494.052,28	86.535.411,42	6,89	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	45.306,94	0,00	0,00
. BRADESCO DI FIF ASSISTENCIAL		5.476.144,68	20.208.135,17	1,61	1,61
. REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		11,56	9.527,70	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		4.876.855,13	7.234.495,18	0,58	0,58
. BNP PARIBAS SMART		214,85	1.592,79	0,00	0,00
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,00	5.757.568,35	0,46	0,46
. BTG PACTUAL		1.963.199,99	2.169.274,36	0,17	0,17
. SAFRA INSTITUCIONAL		135.539,72	24.288.726,05	1,93	1,93
. FIDC COMANCHE CLEAN ENERGY FIDC MERCANTIS		50,00	156.556,42	0,01	0,01
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		4.467,00	3.983.375,07	0,32	0,32
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,99	4.332.651,86	0,35	0,35
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.723,99	10.536.376,97	0,84	0,84
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,13	7.811.824,56	0,62	0,62
Debêntures		20.609	35.279.525,60	2,81	
. CPFL ENERGIA		1.101	11.315.002,93	0,90	0,90
. ELETROMETRÔ		10.248	5.794.284,88	0,46	0,46
. PETROBRÁS		1.760	3.861.733,07	0,31	0,31
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	6.287.803,62	0,50	0,50
. ECOPISTAS		7.000	8.020.701,10	0,64	0,64
Outros Títulos		25.541	212.908.222,59	16,96	
. Certificado de Recebíveis Imobiliários		69	23.194.240,01	1,85	1,85
. Cédula de Crédito Bancário		20	42.346.754,02	3,37	3,37
. Certificado de Cédula de Créd. Bancário		3	117.926.452,46	9,39	9,39
. Depósito a Prazo com Garantia Especial		25.449	29.440.776,10	2,35	2,35
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			210.161.620,07	16,74	
B1. Mercado de Ações			96.269.689,84	7,67	
Companhias Abertas		7.015.216	79.764.084,17	6,35	
. ALL AMER LAT	ON	176.378	1.640.315,40	0,13	
. AMBEV	PN	35.940	2.418.762,00	0,19	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	110.650	4.029.873,00	0,32	
. BR MALLS PAR	ON	83.200	1.507.584,00	0,12	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	200.500	1.964.900,00	0,16	
. CONFAB	PN	88.867	364.354,70	0,03	
. COPEL	PNB	51.870	2.017.743,00	0,16	
. ECORODOVIAS	ON	52.800	736.560,00	0,06	
. ELETROBRÁS	ON	110.777	1.976.261,68	0,16	
. GERDAU - GGBR	PN	87.178	1.264.081,00	0,10	
. HYPERMARCAS	ON	121.600	1.033.600,00	0,08	
. ITAUSA	PN	396.382	4.471.188,96	0,36	
. MARCOPOLO	PN	73.100	518.279,00	0,04	
. MARFRIG	ON	167.800	1.433.012,00	0,11	
. OGX PETRÓLEO	ON	242.300	3.300.126,00	0,26	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	40.879	2.738.893,00	0,22	
. PDG REALT	ON	302.634	1.785.540,60	0,14	
. PETROBRÁS	PN	660.759	14.199.710,91	1,13	
. POSITIVO INF	ON	101.100	584.358,00	0,05	
. RANDON PART	PN	77.450	659.874,00	0,05	
. RENT	ON	32.900	842.240,00	0,07	
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	102.642	1.537.577,16	0,12	
. SUZANO PAPEL	PNA	47.450	319.813,00	0,03	
. TAIPE	ON	1.300.000	8.723.000,00	0,69	
. TELEF. BRASIL	PN	32.208	1.671.595,20	0,13	
. TIM PART S/A	ON	73.092	675.370,08	0,05	
. TRACTEBEL	ON	35.500	1.063.580,00	0,08	
. V-AGRO	ON	1.804.800	577.536,00	0,05	
. VALE R. DOCE	PNA	404.460	15.296.677,20	1,22	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			411.678,28	0,03	

<u>Instituições Financeiras</u>		<u>543.965</u>	<u>16.505.605,67</u>	<u>1,31</u>
. BRADESCO	PN	65.813	2.023.749,75	0,16
. BRASIL	ON	189.752	4.497.122,40	0,36
. ITAU	PN	288.400	9.802.716,00	0,78
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			182.017,52	0,01
<u>B2. Mercado de Opções</u>		<u>-375.400</u>	<u>-582.386,27</u>	<u>-0,05</u>
. OGX PETRÓLEO	ON	-242.300	-417.258,98	-0,03
. PDG REALT	ON	-100	-2,29	0,00
. PETROLEO	PNA	-2.200	-1.980,00	0,00
. VALE	PNA	-130.800	-163.145,00	-0,01
<u>B3. Fundos</u>		<u>19.752.745,78</u>	<u>114.474.316,50</u>	<u>9,12</u>
. SCHRODERS FIA EXCLUSIVO		438.916,55	41.866.908,52	3,33
. FATOR SINERGIA		15.105,99	19.769.362,31	1,57
. GERAÇÃO FUTURO		14.304.331,97	21.098.845,32	1,68
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		161.800,49	15.034.724,15	1,20
. CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVSPA		1.332.793,79	12.968.800,51	1,03
. M. SQUARE PIPE FIA		3.499.796,99	3.735.675,69	0,30
<u>C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</u>		<u>168.233,10</u>	<u>42.844.698,30</u>	<u>3,41</u>
. GOVERNANÇA E GESTÃO		10.727,52	3.548.524,98	0,28
. GOVERNANÇA E GESTÃO II		7.289,75	5.934.785,16	0,47
. FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES		668,84	5.314.032,37	0,42
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		1.537	1.448.386,23	0,12
. MEMORIAL OFFICE		10.000	1.319.999,90	0,11
. ÁGUA BRANCA		39.000	12.441.000,00	0,99
. BRAZILIAN CAPITAL		99.010	12.673.280,00	1,01
. Valores a receber			164.689,66	0,01
<u>D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</u>			<u>82.552.956,36</u>	<u>6,58</u>
<u>D1 - Investimentos em Shopping Center</u>			<u>71.121.163,61</u>	<u>5,67</u>
. Shopping Tatuapé II			21.239.000,00	1,69
. Shopping Plaza Sul			27.759.000,00	2,21
. Shopping Metrô Itaquera			21.495.000,00	1,71
. Valores a receber			628.163,61	0,05
<u>D2 - Investimento Imobiliário</u>			<u>11.431.792,75</u>	<u>0,91</u>
. PANAMBY			12.144.487,33	0,97
. Valores a pagar (-)			-712.694,58	-0,06
<u>E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES</u>		<u>4.418</u>	<u>68.554.544,44</u>	<u>5,46</u>
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		4.418	68.238.561,69	5,44
. VALORES A PAGAR (-)			-74.588,87	-0,01
. VALORES A RECEBER			390.571,62	0,03
<u>F - OUTROS</u>			<u>2.482.959,81</u>	<u>0,20</u>
. Disponíveis			2.776.550,45	0,22
. Depósito Judicial			1.141.068,42	0,09
. Outros realizáveis			512.660,75	0,04
. Outras exigibilidades			-1.034.830,96	-0,08
. Exigível Contingencial			-912.488,85	-0,07

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- SCHRODERS FIA EXCLUSIVO	41.866.908,52	17,17%	3,33%
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	45.306,94	0,02%	0,00%
- BNP PARIBAS SMART	1.592,79	0,00%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA	19.769.362,31	8,11%	1,57%
- GERAÇÃO FUTURO	21.098.845,32	8,65%	1,68%
- RB.FUNDAMENTAL	15.034.724,15	6,17%	1,20%
- BTG PACTUAL	2.169.274,36	0,89%	0,17%
- SAFRA INSTITUCIONAL	24.288.726,05	9,96%	1,93%
- CSHG STRATEGY INST.FICFIA IBOVESPA	12.968.800,51	5,32%	1,03%
- M. SQUARE PIPE FIA	3.735.675,69	1,53%	0,30%
- FIDC COMANCHE CLEAN ENERGY FIDC MERCANTIS	156.556,42	0,06%	0,01%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	3.983.375,07	1,63%	0,32%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	4.332.651,86	1,78%	0,35%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	10.536.376,97	4,32%	0,84%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	7.811.824,56	3,20%	0,62%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS CP FIC DE FI	5.757.568,35	2,36%	0,46%
- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	9.527,70	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	7.234.495,18	2,97%	0,58%
FUNDO EXCLUSIVO			
- METRUS DI FIF BRAM - ASSISTENCIAL	20.208.135,17	8,29%	1,61%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO	3.548.524,98	1,46%	0,28%
- GOVERNANÇA E GESTÃO II	5.934.785,16	2,43%	0,47%
- FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES	5.314.032,37	2,18%	0,42%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	1.448.386,23	0,59%	0,12%
- MEMORIAL OFFICE	1.326.999,90	0,54%	0,11%
- ÁGUA BRANCA	12.532.650,00	5,14%	1,00%
- BRAZILIAN CAPITAL	12.739.319,66	5,22%	1,01%
TOTAL	243.854.426,22	100,00%	19,42%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	762.284.090,07	75,36%	60,72%
RENDA VARIÁVEL	95.687.303,57	9,46%	7,62%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	82.552.956,36	8,16%	6,58%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	68.554.544,44	6,78%	5,46%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	2.482.959,81	0,25%	0,20%
TOTAL	1.011.561.854,25	100,00%	80,58%