

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2011

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			805.503.374,57		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			572.592.543,90	71,08	
<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>		130.263	306.652.001,74	38,07	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			100.300.059,41	12,44	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		31	57.956.122,56	7,19	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	1	7.621.983,31	0,95	0,95
. CDB 381 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	1.204.905,92	0,15	
. CDB 444 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	1.335.763,87	0,17	
. CDB 472 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	299.829,36	0,04	
. CDB 473 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	123.348,43	0,02	
. CDB 475 DIAS - BONSUCESSO	PÓS	1	246.939,12	0,03	0,40
. CDB 367 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	225.073,69	0,03	
. CDB 386 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.412.423,11	0,18	
. CDB 388 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	1.190.300,40	0,15	
. CDB 389 DIAS - DAYCOVAL	PÓS	1	443.464,45	0,06	0,41
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	9.291.085,66	1,15	1,15
. CDB 381 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	1.202.171,53	0,15	
. CDB 395 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	117.496,26	0,01	
. CDB 410 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	55.960,98	0,01	
. CDB 414 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	2.406.396,09	0,30	
. CDB 441 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	55.977,32	0,01	
. CDB 444 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	1.298.710,04	0,16	
. CDB 475 DIAS - INDUSVAL	PÓS	1	246.259,83	0,03	0,67
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	10.734.410,83	1,33	1,33
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.105.527,82	0,26	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.476.425,81	0,43	0,69
. CDB 364 DIAS - PINE	PÓS	1	55.918,39	0,01	
. CDB 366 DIAS - PINE	PÓS	1	782.861,41	0,10	
. CDB 379 DIAS - PINE	PÓS	1	211.132,19	0,03	
. CDB 380 DIAS - PINE	PÓS	1	117.431,97	0,01	
. CDB 387 DIAS - PINE	PÓS	1	223.681,42	0,03	
. CDB 394 DIAS - PINE	PÓS	1	55.920,94	0,01	
. CDB 395 DIAS - PINE	PÓS	1	347.828,95	0,04	0,22
. CDB 3536 DIAS - PROSPER	PÓS	1	5.988.662,24	0,74	0,74
. CDB 358 DIAS - SOFISA	PÓS	1	2.427.174,04	0,30	0,30
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	8.233.010,81	1,02	1,02
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS			-5.581.953,63	-0,69	-0,69
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		33	11.392.479,14	1,41	
. PINE		16	5.401.306,25	0,67	0,67
. ABC		17	5.991.172,89	0,74	0,74
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		110.354,81	30.951.457,71	3,84	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	45.306,94	0,01	0,01
. BNP PARIBAS SMART		214,85	1.592,79	0,00	0,00
. SAFRA INSTITUCIONAL		89.459,54	16.031.154,87	1,99	1,99
. FIDC COMANCHE CLEAN ENERGY FIDC MERCANTIS		25,00	78.278,20	0,01	0,01
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		3.467,00	3.091.641,22	0,38	0,38
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.714,00	2.354.636,94	0,29	0,29
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	5.009.144,17	0,62	0,62
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	4.339.702,58	0,54	0,54

Debêntures		<u>16.734</u>	<u>24.160.278,59</u>	<u>3,00</u>	
. CPFL ENERGIA		800	8.221.618,84	1,02	1,02
. ELETROMETRÔ		7.174	4.056.225,58	0,50	0,50
. PETROBRÁS		1.760	3.861.733,07	0,48	0,48
. ECOPISTAS		7.000	8.020.701,10	1,00	1,00
Outros Títulos		<u>19.061</u>	<u>141.480.204,16</u>	<u>17,56</u>	
. Certificado de Recebíveis Imobiliários		44	15.580.455,71	1,93	1,93
. Cédula de Crédito Bancário		17	33.889.972,96	4,21	4,21
. Certificado de Cédula de Créd. Bancário		1	71.470.973,81	8,87	8,87
. Depósito a Prazo com Garantia Especial		18.999	20.538.801,68	2,55	2,55
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			115.271.728,33	14,31	
B1. Mercado de Ações			<u>53.251.635,14</u>	<u>6,61</u>	
Companhias Abertas		<u>4.250.987</u>	<u>44.592.712,75</u>	<u>5,54</u>	
. ALL AMER LAT	ON	92.866	863.653,80	0,11	
. AMBEV	PN	18.840	1.267.932,00	0,16	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	58.424	2.127.802,08	0,26	
. BR MALLS PAR	ON	43.500	788.220,00	0,10	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	104.800	1.027.040,00	0,13	
. CONFAB	PN	46.291	189.793,10	0,02	
. COPEL	PNB	27.373	1.064.809,70	0,13	
. ECORODOVIAS	ON	27.700	386.415,00	0,05	
. ELETROBRÁS	ON	58.588	1.045.209,92	0,13	
. GERDAU - GGBR	PN	45.564	660.678,00	0,08	
. HYPERMARCAS	ON	64.000	544.000,00	0,07	
. ITAUSA	PN	207.601	2.341.739,28	0,29	
. MARCOPOLO	PN	38.200	270.838,00	0,03	
. MARFRIG	ON	88.400	754.936,00	0,09	
. OGX PETRÓLEO	ON	60.800	828.096,00	0,10	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	21.219	1.421.673,00	0,18	
. PDG REALT	ON	158.192	933.332,80	0,12	
. PETROBRÁS	PN	347.117	7.459.544,33	0,93	
. POSITIVO INF	ON	52.900	305.762,00	0,04	
. RANDON PART	PN	40.600	345.912,00	0,04	
. RENT	ON	17.300	442.880,00	0,05	
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	53.708	804.545,84	0,10	
. SUZANO PAPEL	PNA	25.000	168.500,00	0,02	
. TAIPE	ON	1.300.000	8.723.000,00	1,08	
. TELEF BRASIL	PN	16.869	875.501,10	0,11	
. TIM PART S/A	ON	38.308	353.965,92	0,04	
. TRACTEBEL	ON	18.600	557.256,00	0,07	
. V-AGRO	ON	978.900	313.248,00	0,04	
. VALE R. DOCE	PNA	199.327	7.538.547,14	0,94	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			187.881,74	0,02	
Instituições Financeiras		<u>285.505</u>	<u>8.658.922,39</u>	<u>1,07</u>	
. BRADESCO	PN	34.358	1.056.508,50	0,13	
. BRASIL	ON	100.047	2.371.113,90	0,29	
. ITAUBANCO	PN	151.100	5.135.889,00	0,64	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			95.410,99	0,01	
B2. Mercado de Opções		<u>-119.100</u>	<u>-178.382,00</u>	<u>-0,02</u>	
. OGX PETRÓLEO	ON	-60.800	-102.208,00	-0,01	
. PETROBRAS	PN	-2.200	-1.980,00	0,00	
. VALE R. DOCE	PNA	-56.100	-74.194,00	-0,01	
B3. Fundos		<u>9.135.313,72</u>	<u>62.198.475,19</u>	<u>7,72</u>	
. SCHRODERS FIA EXCLUSIVO		292.926,48	27.941.362,38	3,47	
. FATOR SINERGIA		6.744,90	8.827.108,72	1,10	
. GERAÇÃO FUTURO		6.305.892,54	9.301.171,94	1,15	
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		80.218,87	7.454.047,62	0,93	
. CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA		699.533,94	6.806.841,55	0,85	
. M. SQUARE PIPE FIA		1.749.997,00	1.867.942,98	0,23	

C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		87.008,67	20.185.571,17	2,51	
. GOVERNANÇA E GESTÃO II		7.289,75	5.934.785,16	0,74	
. FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES		510,92	4.059.330,28	0,50	
. BRAZILIAN CAPITAL		79.208	10.138.624,00	1,26	
. Valores a receber			52.831,73	0,01	
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			61.022.772,84	7,58	
D1 - Investimentos em Shopping Center			49.590.980,09	6,16	
Shopping Tatuapé II			21.239.000,00	2,64	
Shopping Plaza Sul			27.759.000,00	3,45	
. Valores a receber			592.980,09	0,07	
D2 - Investimento Imobiliário			11.431.792,75	1,42	
. PANAMBY			12.144.487,33	1,51	
. Valores a pagar (-)			-712.694,58	-0,09	
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.301	35.130.061,04	4,36	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.301	34.961.378,95	4,34	
. VALORES A PAGAR (-)			-45.769,40	-0,01	
. VALORES A RECEBER			214.451,49	0,03	
F - OUTROS			1.300.697,29	0,16	
. Disponíveis			1.251.414,50	0,16	
. Depósitos Judiciais			416.011,86	0,05	
. Outros Realizáveis			416.011,86	0,05	
. Outras Exigibilidades			-366.729,07	-0,05	
. Exigível Contingencial			-416.011,86	-0,05	

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- SCHRODERS FIA EXCLUSIVO	27.941.362,38	24,65%	3,47%
FUNDOS			
- ABN FIC REF. DI. PROFIT PREMIUM	45.306,94	0,04%	0,01%
- BNP PARIBAS SMART	1.592,79	0,00%	0,00%
- FIDC COMANCHE CLEAN ENERGY FIDC MERCANTIS	78.278,20	0,07%	0,01%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST ENERGIA ELETRICA	3.091.641,22	2,73%	0,38%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	2.354.636,94	2,08%	0,29%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	5.009.144,17	4,42%	0,62%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	4.339.702,58	3,83%	0,54%
- FUNDO FATOR SINERGIA	8.827.108,72	7,79%	1,10%
- GERAÇÃO FUTURO	9.301.171,94	8,21%	1,15%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	7.454.047,62	6,58%	0,93%
- CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA	6.806.841,55	6,01%	0,85%
- M. SQUARE PIPE FIA	1.867.942,98	1,65%	0,23%
- SAFRA INSTITUCIONAL	16.031.154,87	14,14%	1,99%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO II	5.934.785,16	5,24%	0,74%
- FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES	4.059.330,28	3,58%	0,50%
- BRAZILIAN CAPITAL	10.191.455,73	8,99%	1,27%
TOTAL	113.335.504,07	100,00%	14,07%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	541.641.086,19	78,25%	67,24%
RENDA VARIÁVEL	53.073.253,14	7,67%	6,59%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	61.022.772,84	8,82%	7,58%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	35.130.061,04	5,08%	4,36%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.300.697,29	0,19%	0,16%
TOTAL	692.167.870,50	100,00%	85,93%