

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2011

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			340.880.918,82		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			180.692.846,15	53,01	
<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>		24.521	48.776.060,93	14,31	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			83.468.675,82	24,49	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		14	63.340.946,59	18,58	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	2	15.497.454,70	4,55	4,55
. CDB 1170 DIAS - BBM	PÓS	1	8.458.561,52	2,48	2,48
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	5.807.268,50	1,70	1,70
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	4.600.332,83	1,35	
. CDB 1856 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	7.799.371,46	2,29	3,64
. CDB 1826 DIAS - BANCO MORADA	PÓS	1	3.495.971,83	1,03	
. CDB 1827 DIAS - BANCO MORADA	PÓS	1	2.103.025,27	0,62	1,64
. CDB 3652 DIAS - PROSPER	PÓS	1	5.988.792,51	1,76	1,76
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	10.147.873,15	2,98	2,98
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	3.394.530,05	1,00	1,00
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	1.646.761,87	0,48	0,48
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS			-5.598.997,10	-1,64	-1,64
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		1.984.841,51	20.127.729,23	5,90	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,15	5.757.568,35	1,69	1,69
. BTG PACTUAL		1.933.199,99	2.136.125,30	0,63	0,63
. SAFRA INSTITUCIONAL		39.443,38	7.068.255,73	2,07	2,07
. FIDC COMANCHE CLEAN ENERGY FIDC MERCANTIS		17,00	53.229,18	0,02	0,02
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	1.236.259,32	0,36	0,36
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	2.146.776,07	0,63	0,63
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	1.729.515,28	0,51	0,51
<u>Debêntures</u>		3.875	11.119.247,01	3,26	
. CPFL ENERGIA		301	3.093.384,09	0,91	0,91
. ELETROMETRÔ		3.074	1.738.059,30	0,51	0,51
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	6.287.803,62	1,84	1,84
<u>Outros Títulos</u>		3.028	37.328.862,39	10,95	
. Certificado de Recebíveis Imobiliários		25	7.613.784,29	2,23	2,23
. Cédula de Crédito Bancário		2	4.449.569,33	1,31	1,31
. Certificado de Cédula de Créd. Bancário		1	20.845.095,27	6,12	6,12
. Depósito a Prazo com Garantia Especial		3.000	4.420.413,50	1,30	1,30
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			81.504.734,01	23,92	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			39.353.251,94	11,55	
<u>Companhias Abertas</u>		2.557.565	31.738.430,65	9,31	
. ALL AMER LAT	ON	81.585	758.740,50	0,22	
. AMBEV	PN	16.635	1.119.535,50	0,33	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	50.754	1.848.460,68	0,54	
. BR MALLS PAR	ON	38.400	695.808,00	0,20	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	92.400	905.520,00	0,27	
. CONFAB	PN	40.823	167.374,30	0,05	
. COPEL	PNB	23.852	927.842,80	0,27	
. ECORODOVIAS	ON	24.400	340.380,00	0,10	
. ELETROBRÁS	ON	50.649	903.578,16	0,27	
. GERDAU - GGBR	PN	40.124	581.798,00	0,17	
. HYPERMARCAS	ON	56.400	479.400,00	0,14	

. ITAUSA	PN	183.030	2.064.578,40	0,61
. MARCOPOLO	PN	33.700	238.933,00	0,07
. MARFRIG	ON	77.900	665.266,00	0,20
. OGX PETRÓLEO	ON	66.500	905.730,00	0,27
. PÃO DE AÇÚCAR	PN	19.053	1.276.551,00	0,37
. PDG REALT	ON	139.354	822.188,60	0,24
. PETROBRÁS	PN	303.977	6.532.465,73	1,92
. POSITIVO INF	ON	46.800	270.504,00	0,08
. RANDON PART	PN	35.800	305.016,00	0,09
. RENT	ON	15.200	389.120,00	0,11
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	47.438	710.621,24	0,21
. SUZANO PAPEL	PNA	21.975	148.111,50	0,04
. TELEF BRASIL	PN	14.839	770.144,10	0,23
. TIM PART S/A	ON	33.760	311.942,40	0,09
. TRACTEBEL	ON	16.400	491.344,00	0,14
. V-AGRO	ON	810.500	259.360,00	0,08
. VALE R. DOCE	PNA	175.317	6.630.488,94	1,95
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			217.627,80	0,06
<u>Instituições Financeiras</u>		250.858	7.614.821,29	2,24
. BRADESCO	PN	30.332	932.709,00	0,27
. BRASIL	ON	87.226	2.067.256,20	0,61
. ITAUBANCO	PN	133.300	4.530.867,00	1,33
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			83.989,09	0,02
<u>B2. Mercado de Opções</u>		-115.500	-169.070,98	-0,05
. OGX PETRÓLEO	ON	-66.500	-112.800,98	-0,03
. VALE R. DOCE	PNA	-49.000	-56.270,00	-0,02
<u>B3. Fundos</u>		7.148.742,39	42.320.553,05	12,42
. SCHRODERS FIA EXCLUSIVO		145.990,06	13.925.546,14	4,09
. FATOR SINERGIA		5.784,10	7.569.709,06	2,22
. GERAÇÃO FUTURO		5.121.650,62	7.554.418,79	2,22
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		70.322,92	6.534.502,31	1,92
. CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA		555.194,69	5.402.342,95	1,58
. M. SQUARE PIPE FIA		1.249.800,00	1.334.033,80	0,39
<u>C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</u>		81.224,43	22.659.127,13	6,64
. GOVERNANÇA E GESTÃO		10.727,52	3.548.524,98	1,04
. FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES		157,92	1.254.702,09	0,37
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		1.537	1.448.386,23	0,42
. MEMORIAL OFFICE		10.000	1.319.999,90	0,39
. ÁGUA BRANCA		39.000	12.441.000,00	3,65
. BRAZILIAN CAPITAL		19.802	2.534.656,00	0,74
. Valores a receber			111.857,93	0,03
<u>D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</u>			21.530.183,52	6,32
<u>D1 - Investimentos em Shopping Center</u>			21.530.183,52	6,32
. Shopping Metrô Itaquera			21.495.000,00	6,31
. - Valores a receber			35.183,52	0,01
<u>E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES</u>		2.117	33.424.483,40	9,80
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.117	33.277.182,74	9,76
. VALORES A PAGAR (-)			-28.819,47	-0,01
. VALORES A RECEBER			176.120,13	0,05
<u>F - OUTROS</u>			1.069.544,61	0,31
. Disponíveis			1.128.336,86	0,33
. Depósitos Judiciais			96.648,89	0,03
. Outras Realizáveis			96.648,89	0,03
. Outras Exigibilidades			-155.441,14	-0,05
. Exigível Contingencial			-96.648,89	-0,03

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- SCHRODERS FIA EXCLUSIVO	13.925.546,14	16,36%	4,09%
FUNDOS			
- BRZ MUTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI	5.757.568,35	6,77%	1,69%
- BTG PACTUAL	2.136.125,30	2,51%	0,63%
- SAFRA INSTITUCIONAL	7.068.255,73	8,31%	2,07%
- FIDC COMANCHE CLEAN ENERGY FIDC MERCANTIS	53.229,18	0,06%	0,02%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	1.236.259,32	1,45%	0,36%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	2.146.776,07	2,52%	0,63%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	1.729.515,28	2,03%	0,51%
- FUNDO FATOR SINERGIA	7.569.709,06	8,89%	2,22%
- GERAÇÃO FUTURO	7.554.418,79	8,88%	2,22%
- RB FUNDAMENTAL INST. FIA	6.534.502,31	7,68%	1,92%
- CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA	5.402.342,95	6,35%	1,58%
- M SQUARE PIPE FIA	1.334.033,80	1,57%	0,39%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO	3.548.524,98	4,17%	1,04%
- FLORESTAS BR FIM PARTICIPAÇÕES	1.254.702,09	1,47%	0,37%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	1.448.386,23	1,70%	0,42%
- MEMORIAL OFFICE	1.326.999,90	1,56%	0,39%
- ÁGUA BRANCA	12.532.650,00	14,73%	3,68%
- BRAZILIAN CAPITAL	2.547.863,93	2,99%	0,75%
TOTAL	85.107.409,41	100,00%	24,97%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	160.565.116,92	62,78%	47,10%
RENDA VARIÁVEL	39.184.180,96	15,32%	11,49%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	21.530.183,52	8,42%	6,32%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	33.424.483,40	13,07%	9,81%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.069.544,61	0,42%	0,31%
TOTAL	255.773.509,41	100,00%	75,03%