

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - ADMINISTRATIVO
PLANO ADMINISTRATIVO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2011					
DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			12.380.703,16		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			10.110.538,56	81,65	
<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>		1.567	2.352.585,87	19,00	
<u>Letras Financeiras Tesouro</u>		10	50.198,14	0,41	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			6.173.142,53	49,85	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		7	2.304.773,87	18,62	
. CDB 180 DIAS - BVA	PÓS	3	808.810,79	6,53	6,53
. CDB 1827 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	753.467,98	6,09	6,09
. CDB 180 DIAS - CACIQUE	PÓS	1	31.357,23	0,25	
. CDB 182 DIAS - CACIQUE	PÓS	1	13.432,79	0,11	0,36
. CDB 1827 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	697.705,08	5,64	5,64
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		2	1.036.282,27	8,37	
. PINE		1	523.107,66	4,23	4,23
. BONSUCESSO		1	513.174,61	4,14	4,14
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		13.817,92	2.832.086,39	22,87	
. BTG PACTUAL		5.000,00	5.524,84	0,04	0,04
. SAFRA INSTITUCIONAL		6.636,80	1.189.315,45	9,61	9,61
. FIDC COMANCHE CLEAN ENERGY FIDC MERCANTIS		3,00	9.393,40	0,08	0,08
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		1.000,00	891.733,85	7,20	7,20
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		494,99	247.251,87	2,00	2,00
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		683,00	488.749,36	3,95	3,95
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		0,13	117,62	-0,01	-0,01
<u>Outros Títulos</u>		1.450	1.534.612,02	12,40	
. Depósito a Prazo com Garantia Especial		1.450	1.534.612,02	12,40	12,40
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			2.544.310,76	20,55	
B1. Mercado de Ações			2.702.674,76	21,83	
<u>Companhias Abertas</u>		160.664	2.470.812,77	19,96	
. ALL AMER LAT	ON	1.927	17.921,10	0,14	
. AMBEV	PN	465	31.294,50	0,25	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	1.472	53.610,24	0,43	
. BR MALLS PAR	ON	1.300	23.556,00	0,19	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	3.300	32.340,00	0,26	
. CONFAB	PN	1.753	7.187,30	0,06	
. COPEL	PNB	645	25.090,50	0,20	
. ECORODOVIAS	ON	700	9.765,00	0,08	
. ELETROBRÁS	ON	1.540	27.473,60	0,22	
. GERDAU - GGBR	PN	1.490	21.605,00	0,17	
. HYPERMARCAS	ON	1.200	10.200,00	0,08	
. ITAUSA	PN	5.751	64.871,28	0,52	
. MARCOPOLO	PN	1.200	8.508,00	0,07	
. MARFRIG	ON	1.500	12.810,00	0,10	
. OGX PETRÓLEO	ON	83.000	1.130.460,00	9,13	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	607	40.669,00	0,33	
. PDG REALT	ON	4.988	29.429,20	0,24	
. PETROBRÁS	PN	9.665	207.700,85	1,68	
. POSITIVO INF	ON	1.400	8.092,00	0,07	
. RANDON PART	PN	1.050	8.946,00	0,07	
. RENT	ON	400	10.240,00	0,08	

. SID. NACIONAL - CSNA	ON	1.496	22.410,08	0,18
. SUZANO PAPEL	PNA	475	3.201,50	0,03
. TELEF BRASIL	PN	500	25.950,00	0,21
. TIM PART S/A	ON	1.024	9.461,76	0,08
. TRACTEBEL	ON	500	14.980,00	0,12
. V-AGRO	ON	15.400	4.928,00	0,04
. VALE R. DOCE	PNA	15.916	601.943,12	4,86
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			6.168,74	0,05
Instituições Financeiras		7.602	231.861,99	1,87
. BRADESCO	PN	1.123	34.532,25	0,28
. BRASIL	ON	2.479	58.752,30	0,47
. ITAUBANCO	PN	4.000	135.960,00	1,10
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			2.617,44	0,02
B2. Mercado de Opções		-94.800	-158.364,00	-1,28
. OGX PETRÓLEO	ON	-83.000	-148.570,00	-1,20
. VALE	PNA	-11.800	-9.794,00	-0,08
F - OUTROS			-274.146,16	1,02
. Disponíveis			238.514,59	1,93
. Depósitos Judiciais			399.828,10	3,23
. Outras Exigibilidades			-512.660,75	-4,14
. Exigível Contingencial			-399.828,10	-3,23

GESTÃO TERCEIRIZADA		Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
FUNDOS				
- BTG PACTUAL		5.524,84	0,20%	0,04%
- SAFRA INSTITUCIONAL		1.189.315,45	41,99%	9,61%
- FIDC COMANCHE CLEAN ENERGY FIDC MERCANTIS		9.393,40	0,33%	0,08%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		891.733,85	31,49%	7,20%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER		247.251,87	8,73%	2,00%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II		488.749,36	17,26%	3,95%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III		117,62	0,00%	0,00%
TOTAL		2.832.086,39	100,00%	22,88%

GESTÃO PRÓPRIA		Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA		7.278.452,17	76,23%	58,79%
RENDA VARIÁVEL		2.544.310,76	26,65%	20,55%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)		-274.146,16	-2,87%	-2,21%
TOTAL		9.548.616,77	100,00%	77,12%