

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL, ASSISTENCIAL E ADMINISTRATIVO

CONSOLIDADO

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2012

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			<u>1.494.820.349,22</u>		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			<u>1.011.671.111,37</u>	<u>67,68</u>	
<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>		<u>163.903</u>	<u>508.238.435,99</u>	<u>34,00</u>	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			<u>231.962.216,13</u>	<u>15,51</u>	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		<u>20,00</u>	<u>118.495.363,50</u>	<u>7,92</u>	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	5	45.552.675,79	3,05	3,05
. CDB 1827 DIAS - BICBANCO	PÓS	1	862.522,64	0,06	0,06
. CDB 181 DIAS - CACIQUE	PÓS	2	48.677,35	0,00	0,00
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	4	61.591.335,20	4,12	4,12
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	2	17.303.278,32	1,16	1,16
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	2	17.712.690,76	1,18	
. CDB 1856 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	9.233.193,52	0,62	1,80
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.453.009,07	0,36	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	2	5.431.276,56	0,36	0,73
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	11.749.319,57	0,79	
. CDB 1827 DIAS - SCHAHIN	PÓS	1	804.559,70	0,05	0,84
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	3.887.912,05	0,26	0,26
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	2	11.270.533,80	0,75	0,75
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-4	-61.591.335,20	-4,12	-4,12
- BANCO MORADA		-4	-10.884.285,63	-0,73	-0,73
. VALORES A RECEBER			70.000,00	0,00	0,00
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		<u>35</u>	<u>13.785.296,00</u>	<u>0,92</u>	
. PINE		17	6.304.640,71	0,42	0,42
. ABC		17	6.893.144,24	0,46	0,46
. BONSUCESSO		1	587.511,05	0,04	0,04
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		<u>22.885.530,64</u>	<u>99.681.556,63</u>	<u>6,67</u>	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	49.073,39	0,00	0,00
. BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM		1.252.032,16	7.791.278,47	0,52	0,52
. REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL		11,56	9.937,47	0,00	0,00
. METRUS SAUDE RF ANS		5.863.015,24	9.412.512,25	0,63	0,63
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,15	4.939.962,94	0,33	0,33
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.708.924,99	4.656.927,35	0,31	0,31
. SAFRA INSTITUCIONAL		210.315,23	40.908.278,97	2,74	2,74
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		4.467,00	3.208.474,98	0,21	0,21
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		8.673,99	2.065.270,81	0,14	0,14
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		14.723,99	5.134.684,53	0,34	0,34
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		8.925,14	3.788.121,69	0,25	0,25
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		11.809.150,31	12.957.443,64	0,87	0,87
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		39,04	4.185.765,46	0,28	0,28
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		5,60	573.824,68	0,04	0,04
<u>Debêntures</u>		<u>5.018.909</u>	<u>58.752.516,07</u>	<u>3,94</u>	
. CPFL ENERGIA		1.101	7.473.289,54	0,50	0,50
. ELETROMETRÔ		10.248	4.108.911,97	0,27	0,27
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	6.514.785,65	0,44	0,44
. ECOPISTAS		7.000	8.147.507,81	0,55	0,55
. COMANCHE PART.		5.000.000	6.654.723,30	0,45	0,45
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		60	25.853.297,80	1,73	1,73

<u>Outros Títulos</u>		<u>25.537</u>	<u>212.717.943,18</u>	<u>14,23</u>	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		69	21.132.841,69	1,41	1,41
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		16	27.896.694,44	1,87	1,87
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		3	120.796.318,91	8,08	8,08
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		25.449	33.552.863,29	2,24	2,24
. VALORES A RECEBER			9.859.428,57	0,66	0,66
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-520.203,72	-0,03	-0,03
<u>B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL</u>			<u>248.167.708,18</u>	<u>16,60</u>	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			<u>101.165.321,78</u>	<u>6,77</u>	
<u>Companhias Abertas</u>		<u>10.215.985</u>	<u>84.015.903,61</u>	<u>5,62</u>	
. ALL AMER LAT	ON	283.478	2.355.702,18	0,16	
. AMBEV	PN	32.368	2.770.053,44	0,19	
. BRF - BRASIL FOODS	ON	164.150	6.925.488,50	0,46	
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	64.300	1.737.386,00	0,12	
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	137.000	1.918.000,00	0,13	
. CEMIG	PN	35.600	804.560,00	0,05	
. COPEL	PNB	10.970	347.749,00	0,02	
. ECORODOVIAS	ON	100.700	1.742.110,00	0,12	
. ELETROBRÁS	ON	146.477	927.199,41	0,06	
. GAFISA	ON	170.000	800.700,00	0,05	
. GERDAU - GGBR	PN	234.278	4.200.604,54	0,28	
. HYPERMARCAS	ON	107.700	1.789.974,00	0,12	
. ISHARES BOVA	CI	26.000	1.551.940,00	0,10	
. ITAUSA	PN	568.950	5.513.125,50	0,37	
. MARCOPOLO	PN	67.500	870.750,00	0,06	
. OGX PETRÓLEO	ON	547.300	2.397.174,00	0,16	
. PÃO DE AÇUCAR	PN	34.379	3.111.299,50	0,21	
. PDG REALT	ON	809.534	2.679.557,54	0,18	
. PETROBRÁS	PN	823.859	16.081.727,68	1,08	
. POSITIVO INF	ON	75.000	378.000,00	0,03	
. RANDON PART	PN	141.450	1.795.000,50	0,12	
. RENT	ON	54.900	2.058.750,00	0,14	
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	65.400	775.644,00	0,05	
. TAIPE	ON	1.724.970	5.140.410,60	0,34	
. TELEF. BRASIL - VIVT	PN	29.008	1.421.392,00	0,10	
. TOTVS	ON	26.400	1.066.296,00	0,07	
. TRACTEBEL	ON	19.700	656.995,00	0,04	
. USIMINAS	PNA	109.100	1.396.480,00	0,09	
. V-AGRO	DIR	1.133.354	464.675,14	0,03	
. V-AGRO	ON	2.253.900	924.099,00	0,06	
. VALE R. DOCE	ON	1.000	42.280,00	0,00	
. VALE R. DOCE	PNA	217.260	8.879.416,20	0,59	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			491.363,88	0,03	
<u>Instituições Financeiras</u>		<u>532.165</u>	<u>17.149.418,17</u>	<u>1,15</u>	
. BRADESCO	PN	67.813	2.384.983,21	0,16	
. BRASIL	ON	116.652	2.986.291,20	0,20	
. ITAU	PN	347.700	11.609.703,00	0,78	
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			168.440,76	0,01	
<u>B2. Mercado de Opções</u>		<u>-584.100</u>	<u>-562.669,02</u>	<u>-0,04</u>	
. OGX PETROLEO A4	ON	-300.900	-132.396,00	-0,01	
. PDG REALT A26	ON	-3.000	-2.170,08	0,00	
. PDG REALT A32	ON	-6.500	-1.813,38	0,00	
. PETROBRAS A18	PN	-50.000	-83.000,00	-0,01	
. PETROBRAS A21	PN	-50.000	-9.000,00	0,00	
. CSNA A36	ON	-64.600	-94.499,56	-0,01	
. USIMINAS A11	PNA	-50.000	-108.000,00	-0,01	
. USIMINAS B11	PNA	-59.100	-131.793,00	-0,01	
. VALORES A RECEBER			3,00	0,00	
<u>B3. Fundos</u>		<u>13.480.668,99</u>	<u>147.565.055,42</u>	<u>9,87</u>	
. ITAU - UNIBANCO METRUS FIA		683.912,62	71.261.128,18	4,77	
. FATOR SINERGIA		15.106,00	26.469.407,84	1,77	

. GERAÇÃO FUTURO	4.287.056,08	6.615.293,54	0,44
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA	161.800,50	19.759.276,65	1,32
. CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA	1.332.793,79	14.389.344,52	0,96
. M. SQUARE PIPE FIA	7.000.000,00	9.070.604,69	0,61
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	174.179,73	67.737.070,97	4,53
. GOVERNANÇA E GESTÃO	10.745,39	3.894.470,88	0,26
. GOVERNANÇA E GESTÃO II	7.510,64	2.730.988,46	0,18
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	1.676,93	15.425.656,74	1,03
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	2.376,00	2.939.076,24	0,20
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	2.650,00	2.650.000,00	0,18
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	770,77	754.713,13	0,05
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO	10.000,00	2.194.999,83	0,15
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	39.000,00	17.082.000,00	1,14
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	99.010,00	15.356.451,00	1,03
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	440,00	4.511.089,37	0,30
. VALORES A RECEBER		197.625,32	0,01
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS		80.663.729,58	5,39
D1 - Investimentos em Shopping Center		69.231.936,83	4,63
. SHOPPING TATUAPE II		20.650.390,29	1,38
. SHOPPING PLAZA SUL		27.168.650,61	1,82
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA		20.808.989,37	1,39
. VALORES A RECEBER		603.906,56	0,04
D2 - Investimento Imobiliário		11.431.792,75	0,76
. PANAMBY		12.144.487,33	0,81
. VALORES A PAGAR (-)		-712.694,58	-0,05
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES	4.629	83.321.013,55	5,58
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	4.629	83.345.924,38	5,58
. VALORES A PAGAR (-)		-188.421,04	-0,01
. VALORES A RECEBER		163.510,21	0,01
F - OUTROS		3.259.715,57	0,22
. DISPONIVEL		4.362.977,74	0,29
. DEPOSITOS JUDICIAIS		742.372,10	0,05
. OUTROS REALIZAVEIS		390.223,00	0,03
. OUTRAS EXIGIBILIDADES		-1.493.485,17	-0,10
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL		-742.372,10	-0,05

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- ITAU - UNIBANCO METRUS FIA	71.261.128,18	22,62%	4,77%
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	49.073,39	0,02%	0,00%
- FUNDO FATOR SINERGIA	26.469.407,84	8,40%	1,77%
- GERAÇÃO FUTURO	6.615.293,54	2,10%	0,44%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	19.759.276,65	6,27%	1,32%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	4.656.927,35	1,48%	0,31%
- SAFRA INSTITUCIONAL	40.908.278,97	12,99%	2,74%
- CSHG STRATEGY INST.FICFIA IBOVESPA	14.389.344,52	4,57%	0,96%
- M. SQUARE PIPE FIA	9.070.604,69	2,88%	0,61%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	3.208.474,98	1,02%	0,21%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER	2.065.270,81	0,66%	0,14%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II	5.134.684,53	1,63%	0,34%
- FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III	3.788.121,69	1,20%	0,25%
- FIDC - BCSUL VERAX CPP 360	12.957.443,64	4,11%	0,87%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.	4.185.765,46	1,33%	0,28%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	573.824,68	0,18%	0,04%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS CP FIC DE FI	4.939.962,94	1,57%	0,33%

- REAL FAQ EXTRA DI - ASSISTENCIAL	9.937,47	0,00%	0,00%
- BRADESCO DED. SAUDE ANS	9.412.512,25	2,99%	0,63%
- BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	7.791.278,47	2,47%	0,52%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO	3.894.470,88	1,24%	0,26%
- GOVERNANÇA E GESTÃO II	2.730.988,46	0,87%	0,18%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	15.425.656,74	4,90%	1,03%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	2.939.076,24	0,93%	0,20%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	2.650.000,00	0,84%	0,18%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	754.713,13	0,24%	0,05%
- MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO	2.206.799,83	0,70%	0,15%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	17.185.350,00	5,46%	1,15%
- BTG PACTUAL CORPOTATE OFFICE FI IMOBILIARIO	15.438.926,32	4,90%	1,03%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	4.511.089,37	1,43%	0,30%
TOTAL	314.983.683,02	100,00%	21,07%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	911.989.554,74	77,30%	61,01%
RENTA VARIÁVEL	100.602.652,76	8,53%	6,73%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	80.663.729,58	6,84%	5,40%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	83.321.013,55	7,06%	5,57%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	3.259.715,57	0,28%	0,22%
TOTAL	1.179.836.666,20	100,00%	78,93%