

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO I

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2012

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			917.103.017,58		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			663.378.136,73	72,33	
<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>		131.413	412.995.656,40	45,03	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			73.053.630,74	7,97	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		4,00	41.480.920,66	4,52	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	1	9.003.710,56	0,98	0,98
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	2	33.473.833,57	3,65	3,65
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	10.648.171,27	1,16	1,16
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	12.398.883,53	1,35	1,35
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS	1	2.049.020,58	0,22	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS	1	3.383.584,48	0,37	0,59
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	9.392.111,50	1,02	1,02
. VALOR A RECEBER - FDO. GARANTIDOR CRÉDITO			38.043,80	0,00	0,00
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-2	-33.473.833,57	-3,65	-3,65
- BANCO MORADA		-2	-5.432.605,06	-0,59	-0,59
<u>Letra Financeira Subordinada</u>		33	12.589.729,43	1,37	
. PINE		16	5.696.585,19	0,62	0,62
. ABC		17	6.893.144,24	0,75	0,75
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		4.962.671,54	18.982.980,65	2,07	
. ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM		516,24	49.073,39	0,01	0,01
. SAFRA INSTITUCIONAL		21.525,68	4.186.945,43	0,46	0,46
. FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA		3.467,00	2.490.213,28	0,27	0,27
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		4.713,99	1.122.398,72	0,12	0,12
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		7.000,00	2.441.102,38	0,27	0,27
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		4.958,18	2.104.415,07	0,23	0,23
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		4.920.479,29	5.398.934,85	0,59	0,59
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		9,76	1.046.441,36	0,11	0,11
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		1,40	143.456,17	0,02	0,02
<u>Debêntures</u>		2.515.004	32.708.100,27	3,57	
. CPFL ENERGIA		800	5.430.183,14	0,59	0,59
. ELETROMETRÔ		7.174	2.876.398,76	0,31	0,31
. ECOPISTAS		7.000	8.147.507,81	0,89	0,89
. COMANCHE PART.		2.500.000	3.327.361,65	0,36	0,36
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		30	12.926.648,91	1,41	1,41
<u>Outros Títulos</u>		19.060	144.620.749,32	15,77	
. CERTIFICADO DE RECEBIVEIS IMOBILIARIOS		44	13.626.450,36	1,49	1,49
. CEDULA DE CREDITO BANCARIO		16	27.896.694,44	3,04	3,04
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCARIO		1	73.210.088,30	7,98	7,98
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		18.999	23.308.422,83	2,54	2,54
. VALORES A RECEBER			7.099.297,11	0,77	0,77
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CREDITOS			-520.203,72	-0,06	-0,06

B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			125.839.982,76	13,72
B1. Mercado de Ações		6.524.489,00	54.295.944,96	5,92
Companhias Abertas		6.249,084	45.445.209,71	4,96
. ALL AMER LAT	ON	170.266	1.414.910,46	0,15
. AMBEV	PN	18.004	1.540.782,32	0,17
. BRF - BRASIL FOODS	ON	90.424	3.814.988,56	0,42
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	33.200	897.064,00	0,10
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	74.100	1.037.400,00	0,11
. CEMIG	PN	18.400	415.840,00	0,05
. COPEL	PNB	5.673	179.834,10	0,02
. ECORODOVIAS	ON	55.500	960.150,00	0,10
. ELETROBRÁS	ON	94.188	596.210,04	0,07
. GAFISA	ON	79.800	375.858,00	0,04
. GERDAU - GGBR	PN	123.064	2.206.537,52	0,24
. HYPERMARCAS	ON	57.500	955.650,00	0,10
. ITAUSA	PN	301.141	2.918.056,29	0,32
. MARCOPOLO	PN	35.100	452.790,00	0,05
. OGX PETRÓLEO	ON	223.100	977.178,00	0,11
. PÃO DE AÇUCAR	PN	18.419	1.666.919,50	0,18
. PDG REALT	ON	449.492	1.487.818,52	0,16
. PETROBRÁS	PN	409.817	7.999.627,84	0,87
. POSITIVO INF	ON	38.200	192.528,00	0,02
. RANDON PART	PN	72.700	922.563,00	0,10
. RENT	ON	28.400	1.065.000,00	0,12
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	32.300	383.078,00	0,04
. TAIPE	ON	1.724.970	5.140.410,60	0,56
. TELEF. BRASIL - VIVT	PN	15.469	757.981,00	0,08
. TOTVS	ON	12.200	492.758,00	0,05
. TRACTEBEL	ON	10.000	333.500,00	0,04
. USIMINAS	PNA	52.300	669.440,00	0,07
. V-AGRO	DIR	633.530	259.747,30	0,03
. V-AGRO	ON	1.259.900	516.559,00	0,06
. VALE R. DOCE	ON	500	21.140,00	0,00
. VALE R. DOCE	PNA	111.427	4.554.021,49	0,50
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			238.868,17	0,03
Instituições Financeiras		275,405	8.850.735,25	0,97
. BRADESCO	PN	34.558	1.215.404,86	0,13
. BRASIL	ON	62.947	1.611.443,20	0,18
. ITAU	PN	177.900	5.940.081,00	0,65
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			83.806,19	0,01
B2. Mercado de Opções		-222.800,00	-226.713,56	-0,02
. OGX PETROLEO A4	ON	-100.000	-44.000,00	0,00
. PDG REALT A26	ON	-1.500	-1.085,04	0,00
. PDG REALT A32	ON	-3.200	-892,74	0,00
. PETROBRAS A18	PN	-8.500	-14.110,00	0,00
. PETROBRAS A21	PN	-25.000	-4.500,00	0,00
. CSNA A36	ON	-32.300	-47.249,78	-0,01
. USIMINAS A11	PNA	-25.000	-54.000,00	-0,01
. USIMINAS B11	PNA	-27.300	-60.879,00	-0,01
. VALORES A RECEBER			3,00	0,00
B3. Fundos		7.808.600,83	71.770.751,36	7,83
. ITAU - UNIBANCO METRUS FIA		317.669,71	33.099.991,64	3,61
. FATOR SINERGIA		6.744,90	11.818.709,03	1,29
. GERAÇÃO FUTURO		3.204.433,42	4.967.888,26	0,54
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		80.218,87	9.796.427,76	1,07
. CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA		699.533,94	7.552.432,32	0,82
. M. SQUARE PIPE FIA		3.499.999,99	4.535.302,35	0,49
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		90.393,39	31.690.889,08	3,46
. GOVERNANÇA E GESTÃO II		7.510,64	2.730.988,46	0,30
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		1.280,99	11.783.581,73	1,28
. FIP BVEP PLAZA		1.590,00	1.590.000,00	0,17

. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		539,77	528.524,21	0,06
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		79.208,00	12.285.160,80	1,34
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		264,00	2.706.653,62	0,30
. VALORES A RECEBER			65.980,26	0,01
D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			59.826.240,85	6,52
D1 - Investimentos em Shopping Center			48.394.448,10	5,28
. SHOPPING TATUAPE II			20.650.390,29	2,25
. SHOPPING PLAZA SUL			27.168.650,61	2,96
. VALORES A RECEBER			575.407,20	0,06
D2 - Investimento Imobiliário			11.431.792,75	1,25
. PANAMBY			12.144.487,33	1,32
. VALORES A PAGAR (-)			-712.694,58	-0,08
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.287	35.528.194,34	3,88
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.287	35.602.603,48	3,88
. VALORES A PAGAR (-)			-124.549,30	-0,01
. VALORES A RECEBER			50.140,16	0,01
F - OUTROS			839.573,82	0,09
. DISPONIVEL			1.237.003,05	0,13
. DEPOSITOS JUDICIAIS			333.512,07	0,04
. OUTROS REALIZAVEIS			334.159,94	0,04
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-731.589,17	-0,08
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-333.512,07	-0,04

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- ITAU - UNIBANCO METRUS FIA	33.099.991,64	27,03%	3,61%
FUNDOS			
- ABN FIC REF DI. PROFIT PREMIUM	49.073,39	0,04%	0,01%
- FUNDO FATOR SINERGIA	11.818.709,03	9,65%	1,29%
- GERAÇÃO FUTURO	4.967.888,26	4,06%	0,54%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	9.796.427,76	8,00%	1,07%
- SAFRA INSTITUCIONAL	4.186.945,43	3,42%	0,46%
- CSHG STRATEGY INST.FICFIA IBOVESPA	7.552.432,32	6,17%	0,82%
- M. SQUARE PIPE FIA	4.535.302,35	3,70%	0,49%
- FIDC - CEEE - CIA. EST. DIST. ENERGIA ELETRICA	2.490.213,28	2,03%	0,27%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER	1.122.398,72	0,92%	0,12%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II	2.441.102,38	1,99%	0,27%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III	2.104.415,07	1,72%	0,23%
- FIDC - BCSUL VERAX CPP 360	5.398.934,85	4,41%	0,59%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	1.046.441,36	0,85%	0,11%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	143.456,17	0,12%	0,02%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO II	2.730.988,46	2,23%	0,30%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	11.783.581,73	9,62%	1,28%
- FIP BVEP PLAZA	1.590.000,00	1,30%	0,17%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	528.524,21	0,43%	0,06%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	12.351.141,06	10,09%	1,35%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	2.706.653,62	2,21%	0,30%
TOTAL	122.444.621,09	100,00%	13,36%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENTA FIXA	644.395.156,08	81,09%	70,26%
RENTA VARIÁVEL	54.069.231,40	6,80%	5,90%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	59.826.240,85	7,53%	6,52%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	35.528.194,34	4,47%	3,87%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	839.573,82	0,11%	0,09%
TOTAL	794.658.396,49	100,00%	86,64%