

RESUMO DOS INVESTIMENTOS - PREVIDENCIAL

PLANO II

POSIÇÃO CONTÁBIL EM 31.12.2012

DISCRIMINAÇÃO	Espécie Tipo	Quantidade	Valor em R\$	Alocação do patrimônio (%)	Diversificação (%)
INVESTIMENTO TOTAL DO INSTITUTO			462.941.454,33		
A - INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA			249.841.691,77	53,97	
<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>		28.721	86.512.627,38	18,69	
<u>APLICAÇÕES EM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS</u>			106.574.343,23	23,02	
<u>Certificado de Depósito Bancário</u>		12,00	57.009.810,82	12,31	
. CDB 1.826 DIAS - ABC	PÓS	2	18.271.435,51	3,95	3,95
. CDB 7307 DIAS - CRUZEIRO DO SUL	PÓS	1	18.137.405,30	3,92	3,92
. CDB 1826 DIAS - FIBRA	PÓS	1	6.655.107,05	1,44	1,44
. CDB 1653 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	5.313.807,23	1,15	
. CDB 1856 DIAS - ITAÚ	PÓS	1	9.233.193,52	1,99	3,14
. CDB 1826 DIAS - MORADA	PÓS		3.403.988,49	0,74	
. CDB 1827 DIAS - MORADA	PÓS		2.047.692,08	0,44	1,18
. CDB 1826 DIAS - SCHAHIN	PÓS	2	11.749.319,57	2,54	2,54
. CDB 1827 DIAS - SOFISA	PÓS	2	3.887.912,05	0,84	0,84
. CDB 2995 DIAS - VOTORANTIM	PÓS	1	1.878.422,30	0,41	0,41
. PROVISÃO PARA PERDAS S/CRÉDITOS					
- BANCO CRUZEIRO DO SUL		-1	-18.137.405,30	-3,92	-3,92
- BANCO MORADA		2	-5.451.680,57	-1,18	-1,18
. VALORES A RECEBER - FUNDO GARANTIDOR CRÉDITO			20.613,59	0,00	0,00
<u>Fundo de Invest. em Cotas de Fundos de Invest.</u>		4.199.995,83	49.564.532,41	10,71	
. BRZ MULTIRECEBÍVEIS CREDITO PRIVADO FIC DE FI		4.730,16	4.939.962,94	1,07	1,07
. BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP		3.024.304,06	3.797.317,08	0,82	0,82
. SAFRA INSTITUCIONAL		179.392,45	34.893.509,39	7,54	7,54
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER		2.474,99	589.295,05	0,13	0,13
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER II		3.000,00	1.046.186,74	0,23	0,23
. FIDC - MULTISSETORIAL BVA MASTER III		1.976,00	838.679,16	0,18	0,18
. FIDC - BCSUL VERAX CPP 360		984.095,86	1.079.786,98	0,23	0,23
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD.PREF.		19,52	2.092.882,73	0,45	0,45
. FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR		2,80	286.912,34	0,06	0,06
<u>Debêntures</u>		1.703.897	21.532.553,89	4,65	
. CPFL ENERGIA		301	2.043.106,40	0,44	0,44
. ELETROMETRÔ		3.074	1.232.513,21	0,27	0,27
. ROTA DAS BANDEIRAS		500	6.514.785,65	1,41	1,41
. COMANCHE PART.		1.700.000	2.262.605,92	0,49	0,49
. CIA. PAULISTA DE SECURITIZAÇÃO		22	9.479.542,71	2,05	2,05
<u>Outros Títulos</u>		3.026	35.222.167,27	7,61	
. CERTIFICADO DE RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS		25	7.506.391,33	1,62	1,62
. CERTIFICADO DE CÉDULA DE CRED. BANCÁRIO		1	21.352.641,92	4,61	4,61
. DEPOSITO A PRAZO COM GARANTIA ESPECIAL		3.000	5.105.169,94	1,10	1,10
. VALORES A RECEBER			1.257.964,08	0,27	0,27
B-INVESTIMENTOS DE RENDA VARIÁVEL			106.941.191,05	23,10	
<u>B1. Mercado de Ações</u>			42.758.391,34	9,24	
<u>Companhias Abertas</u>		3.678.472	34.712.972,68	7,50	
. ALL AMER LAT	ON	108.985	905.665,35	0,20	
. AMBEV	PN	13.899	1.189.476,42	0,26	

. BRF - BRASIL FOODS	ON	70.754	2.985.111,26	0,64
. BR MALLS PARTICIPAÇÕES	ON	30.000	810.600,00	0,18
. BVMF - BMF BOVESPA	ON	60.700	849.800,00	0,18
. CEMIG	PN	16.600	375.160,00	0,08
. COPEL	PNB	5.152	163.318,40	0,04
. ECORODOVIAS	ON	43.700	756.010,00	0,16
. ELETROBRÁS	ON	50.149	317.443,17	0,07
. GAFISA	ON	86.000	405.060,00	0,09
. GERDAU - GGBR	PN	107.724	1.931.491,32	0,42
. HYPERMARCAS	ON	48.100	799.422,00	0,17
. ITAUSA	PN	259.103	2.510.708,07	0,54
. MARCOPOLO	PN	31.300	403.770,00	0,09
. OGX PETRÓLEO	ON	223.300	978.054,00	0,21
. PÃO DE AÇUCAR	PN	15.353	1.389.446,50	0,30
. PDG REALT	ON	348.354	1.153.051,74	0,25
. PETROBRÁS	PN	368.677	7.196.575,04	1,55
. POSITIVO INF	ON	35.600	179.424,00	0,04
. RANDON PART	PN	66.000	837.540,00	0,18
. RENT	ON	25.600	960.000,00	0,21
. SID. NACIONAL - CSNA	ON	32.300	383.078,00	0,08
. TELEF. BRASIL - VIVT	PN	12.939	634.011,00	0,14
. TOTVS	ON	13.700	553.343,00	0,12
. TRACTEBEL	ON	9.300	310.155,00	0,07
. USIMINAS	PNA	56.800	727.040,00	0,16
. V-AGRO	DIR	480.566	197.032,06	0,04
. V-AGRO	ON	955.700	391.837,00	0,08
. VALE R. DOCE	ON	500	21.140,00	0,00
. VALE R. DOCE	PNA	101.617	4.153.086,79	0,90
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			245.122,56	0,05
Instituições Financeiras		248.858	8.045.418,66	1,74
. BRADESCO	PN	32.232	1.133.599,44	0,24
. BRASIL	ON	51.826	1.326.745,60	0,29
. ITAU	PN	164.800	5.502.672,00	1,19
. DIVIDENDOS/JUROS A RECEBER			82.401,62	0,02
B2. Mercado de Opções		-227.400	-236.779,46	-0,05
. OGX PETROLEO A4	ON	-100.000	-44.000,00	-0,01
. PDG REALT A26	ON	-1.500	-1.085,04	0,00
. PDG REALT A32	ON	-3.300	-920,64	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	-31.800	-70.914,00	-0,02
B3. Fundos		3.705.122,65	64.419.579,17	13,92
. ITAU - UNIBANCO METRUS FIA		346.563,15	36.110.579,15	7,80
. FATOR SINERGIA		5.784,10	10.135.163,35	2,19
. GERAÇÃO FUTURO		227.257,81	352.321,69	0,08
. RB FUNDAMENTAL INST. FIA		70.322,92	8.587.922,04	1,86
. CSHG STRATEGY INST. FICFIA IBOVESPA		555.194,69	5.994.091,27	1,29
. M. SQUARE PIPE FIA		2.499.999,99	3.239.501,67	0,70
C-INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		83.786,32	36.046.181,89	7,79
. GOVERNANÇA E GESTÃO		10.745,39	3.894.470,88	0,84
. FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES		395,93	3.642.075,01	0,79
. P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP		2.376,00	2.939.076,24	0,63
. FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA		1.060,00	1.060.000,00	0,23
. RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES		231,00	226.188,92	0,05
. MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO		10.000,00	2.194.999,83	0,47
. ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO		39.000,00	17.082.000,00	3,69
. BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO		19.802,00	3.071.290,20	0,66
. CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO		176,00	1.804.435,75	0,39
. VALORES A RECEBER			131.645,06	0,03

D-INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			20.837.488,73	4,50	
D1 - Investimentos em Shopping Center			20.837.488,73	4,50	
. SHOPPING METRÔ ITAQUERA			20.808.989,37	4,49	
. VALORES A RECEBER			28.499,36	0,01	
E - EMPRÉSTIMOS AOS PARTICIPANTES		2.342	47.792.819,21	10,32	
. OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES		2.342	47.743.320,90	10,31	
. VALORES A PAGAR (-)			-63.871,74	-0,01	
. VALORES A RECEBER			113.370,05	0,02	
F - OUTROS			1.482.081,68	0,32	
. DISPONIVEL			1.799.840,70	0,39	
. DEPOSITOS JUDICIAIS			54.561,85	0,01	
. OUTROS REALIZAVEIS			56.063,06	0,01	
. OUTRAS EXIGIBILIDADES			-373.822,08	-0,08	
. EXIGIVEL CONTINGENCIAL			-54.561,85	-0,01	

GESTÃO TERCEIRIZADA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Terceirizada	(%) em relação ao Recursos Garantidores
CARTEIRA			
- ITAU - UNIBANCO METRUS FIA	36.110.579,15	24,07%	7,80%
FUNDOS			
- FUNDO FATOR SINERGIA	10.135.163,35	6,76%	2,19%
- GERAÇÃO FUTURO	352.321,69	0,23%	0,08%
- RB.FUNDAMENTAL INST. FIA	8.587.922,04	5,72%	1,86%
- BTG PACTUAL EMISSÕES PRIMARIAS II FIRF CP	3.797.317,08	2,53%	0,82%
- SAFRA INSTITUCIONAL	34.893.509,39	23,26%	7,54%
- CSHG STRATEGY INST.FICFIA IBOVESPA	5.994.091,27	4,00%	1,29%
- M. SQUARE PIPE FIA	3.239.501,67	2,16%	0,70%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER	589.295,05	0,39%	0,13%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER II	1.046.186,74	0,70%	0,23%
- FIDC - MULTISETORIAL BVA MASTER III	838.679,16	0,56%	0,18%
- FIDC - BCSUL VERAX CPP 360	1.079.786,98	0,72%	0,23%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I SUBORD. PREF.	2.092.882,73	1,39%	0,45%
- FIDC - VINCI CREDITO E DESENVOLVIMENTO I COTA SENIOR	286.912,34	0,19%	0,06%
- BRZ MULTIRECEBIVEIS CP FIC DE FI	4.939.962,94	3,29%	1,07%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			
- GOVERNANÇA E GESTÃO	3.894.470,88	2,60%	0,84%
- FLORESTAS BR FI EM PARTICIPAÇÕES	3.642.075,01	2,43%	0,79%
- P2 BR INFRAESTRUTURA FIC DE FIP	2.939.076,24	1,96%	0,63%
- FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES BVEP PLAZA	1.060.000,00	0,71%	0,23%
- RIVIERA GR INDUSTRIAL FUNDO INV. EM PARTICIPAÇÕES	226.188,92	0,15%	0,05%
- MEMORIAL OFFICE FI IMOBILIARIO	2.206.799,83	1,47%	0,48%
- ÁGUA BRANCA FI IMOBILIARIO	17.185.350,00	11,45%	3,71%
- BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FI IMOBILIARIO	3.087.785,26	2,06%	0,67%
- CLARITAS LOGISTICA I FI IMOBILIARIO	1.804.435,75	1,20%	0,39%
TOTAL	150.030.293,47	100,00%	32,41%

GESTÃO PRÓPRIA	Distribuição	(%) em relação a Gestão Própria	(%) em relação ao Recursos Garantidores
RENDA FIXA	200.277.159,36	64,00%	43,26%
RENDA VARIÁVEL	42.521.611,88	13,59%	9,19%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	20.837.488,73	6,66%	4,50%
EMPRÉSTIMO PESSOAL	47.792.819,21	15,27%	10,32%
OUTROS (Disponível e Outros Realizáveis)	1.482.081,68	0,47%	0,32%
TOTAL	312.911.160,86	100,00%	67,59%