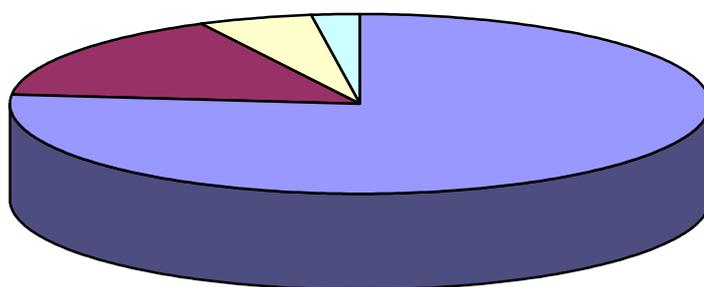




Demonstrativo Analítico de Investimentos e Enquadramento das Aplicações - DAIEA
1º Trimestre de 2002

Distribuição dos Investimentos por Segmento				
Segmento	1º Trimestre de 2001		1º Trimestre de 2002	
	Valor	Percentual	Valor	Percentual
Renda Fixa	4.066.595.148,13	52,69%	13.019.025.796,41	76,79%
Renda Variável	2.463.476.306,38	31,92%	2.657.909.257,28	15,68%
Investimentos Imobiliários	909.130.562,01	11,78%	922.970.502,32	5,44%
Empréstimos e Financiamentos	278.782.920,04	3,61%	353.512.940,44	2,09%
Total dos Investimentos	7.717.984.936,56		16.953.418.496,45	

Distribuição dos Investimentos por Segmento - 1º Trimestre de 2002



■ Renda Fixa
 ■ Renda Variável
 ■ Investimentos Imobiliários
 ■ Empréstimos e Financiamentos

Distribuição dos Investimentos por Plano			
Plano de Benefício		Valor	% / Total
Plano BD			
- Renda Fixa		13.014.830.082,96	76,77%
- Renda Variável		2.657.909.257,28	15,68%
- Investimentos Imobiliários		922.970.502,32	5,44%
- Empréstimos e Financiamentos		353.512.940,44	2,09%
Plano CD			
- Renda Fixa		4.195.713,45	0,02%
- Renda Variável		0	
- Investimentos Imobiliários		0	
- Empréstimos e Financiamentos		0	

Distribuição dos Investimentos - Gestão Terceirizada

Gestor	Valor	Percentual
Banco BBA S.A.	495.825.935,48	13,74%
Banco Westlb S.A.	17.949.639,20	0,50%
Banco Boston S.A.	78.427.715,09	2,17%
Banco Bradesco S.A.	617.029.294,92	17,10%
Banco Dresdner S.A.	16.703.358,43	0,46%
Banco do Brasil S.A.	372.268.683,40	10,32%
Banco Santander S.A.	584.792.990,84	16,21%
Banco Itau S.A.	1.072.330.646,68	29,72%
Banco Safra S.A.	145.725.012,95	4,04%
Banco Votorantim S.A.	37.116.396,21	1,03%
Banco CSFB S.A	39.245.400,07	1,09%
Banco Pactual S.A	6.441.540,66	0,18%
Investidor Profissional S.A	29.507.650,54	0,82%
Latinvest S.A	27.185.834,40	0,75%
Dinamo S.A	31.123.521,12	0,86%
Banco Fator S.A	37.030.418,04	1,03%
Total	3.608.704.038,03	

Tabela Comparativa dos Limites de Alocação definidos da Res. 2829

Segmento	Carteira	Financeiro	Porcentagem
Segmento de Renda Fixa	Renda Fixa – Baixo Risco de Crédito	12.627.080.810,09	74,48%
	Renda Fixa – Médio e Alto Risco de Crédito	356.939.202,14	2,11%
Segmento de Renda Variável	Renda Variável – Ações em Mercado	1.308.248.689,15	7,72%
	Renda Variável – Participações	1.349.660.568,12	7,96%
	Renda Variável – Outros Ativos	136,50	0,00%
Imóveis	Imóveis – Desenvolvimento	8.828.312,38	0,05%
	Imóveis – Aluguéis e Renda	751.508.739,98	4,43%
	Imóveis – Fundos Imobiliários	154.678.099,41	0,91%
	Imóveis – Outros Investimentos	7.955.350,55	0,05%
Empréstimos e Financiamentos	Empréstimos	353.512.940,44	2,09%
	Financiamentos	-	0,00%
Derivativos	Derivativos de Renda Fixa para Hedge	34.933.640,59	0,21%
	Derivativos de Renda Fixa que não é para Hedge	72.143,60	0,00%
	Derivativos de Renda Variável para Hedge	-	0,00%
	Derivativos de Renda Variável que não é para Hedge	-	0,00%
TOTAL		16.953.418.496,45	100,00%

Composição do Segmento Renda Variável

Mercado à Vista			
Setor		Valor de Mercado	% s/Segmento
Alimentos		72.517.067,73	2,70%
Perdigão	ON	33.833.460,00	
Perdigão	PN	30.350.807,73	
Sadia	PN	8.332.800,00	
Auto Peças		5.650.000,00	0,21%
Fras-le	ON	5.650.000,00	
Aviação		41.709.727,36	1,55%
Embraer	ON	6.409.767,00	
Embraer	PN	27.243.795,11	

Bancos		164.185.203,49	6,11%
Bradesco	PN	61.414.155,42	
Bradespar	PN	2.877.870,31	
Itaubanco	PN	10.535.269,60	
Itausa	PN	83.452.555,20	
Bebidas e Fumo		18.169.754,36	0,68%
Ambev	ON	18.169.754,36	
Bens de Capital		6.828.036,37	0,25%
Inepar	ON	4.241.700,99	
Inepar	PN	2.586.335,38	
Comunicação		77.114,16	0,00%
Gazeta Mercantil	PN	77.114,16	
Diversões e Entretenimentos		12.392.253,31	0,46%
Parque Temático Playcenter	ON	4.223.198,10	
Parque Temático Playcenter	PN	8.169.055,21	
Energia Elétrica		194.928.400,37	7,26%
Celesc	PNB	7.571.984,00	
Cemig	ON	3.236.872,00	
Cemig	PNB	24.957.445,19	
Coelce	PNA	26.101.777,91	
Copel	ON	8.559.243,00	
Copel	PNB	15.123.779,00	
Eletrobras	ON	19.984.183,44	
Eletrobras	PNB	16.021.296,00	
Eletropaulo	PN	10.869.570,58	
GTD	ON	12.869.110,00	
GTD	PN	18.486.576,00	
Inepar Energia	ON	3.179.705,50	
Inepar Energia	PNA	2.775.028,47	
Light	ON	2.172.396,00	
Transm. Paulista	PN	6.808.584,00	
Mineração		50.113.286,58	1,87%
Litel	ON	803,00	
Litel	PNA	1.606,00	
Paranapanema	ON	8.647.778,49	
Vale	PNA	10.428.065,00	
Vale	PNA	15.178.150,00	
Papel Celulose		54.405.862,34	2,03%
Aracruz	PNB	6.445.750,00	
Klabin	PN	9.548.124,84	
Ripasa	PN	30.426.917,50	
Votorantim C.	PN	4.266.940,50	
Votorantim C.	PN	3.718.129,50	
Petróleo		180.953.841,88	6,74%
Petrobras	ON	49.566.541,79	
Petrobras	PN	126.760.422,30	
Química Petroquímica		22.174.398,50	0,83%
Copene	ON	19.779.793,70	
Copene	PNA	2.394.604,80	

Saneamento		28.969.643,12	1,08%
Sabesp	ON	28.969.643,12	
Serviços		3.176.392,00	0,12%
Estacion. Cinelândia	ON	3.176.392,00	
Siderurgia		66.790.497,85	2,49%
Acesita	ON	9.853.291,52	
Acesita	PN	7.726.705,02	
Gerdau	PN	20.208.780,00	
CSN	ON	5.711.326,00	
Sid. Tubarão	PN	4.645.371,00	
Usiminas	PNA	13.470.960,00	
Telecomunicação		592.867.691,70	22,07%
Americel	ON	273.228,02	
CRT Celular	PNA	14.158.259,40	
Embratel Part.	ON	9.309.096,51	
Embratel Part.	PN	40.148.252,00	
Invitel	ON	27.155.547,89	
Newtel	ON	24.820.833,74	
Globo Cabo	PN	6.932.940,00	
Tele Centro Oeste	ON	7.441.989,62	
Tele Celular Sul	ON	3.743.581,15	
Tele Celular Sul	PN	19.762.818,00	
Brasil Telecom Part.	ON	18.637.450,84	
Brasil Telecom Part.	PN	64.520.720,00	
Telebras	PN	4.537,05	
Brasil Telecom	PN	25.082.217,00	
Recibo de Telebras	PN	28.376.958,46	
Telef. Data brasil Holding	PN	183.750,39	
Telet	ON	601.416,10	
Tele Leste	ON	801.832,53	
Telemar NL	PNA	37.216.996,94	
Telemig Celular Part	ON	4.372.674,37	
Tele Norte	ON	903.154,42	
Tele Nordeste Celular	ON	3.472.780,85	
Tele Nordeste Celular	PN	14.258.502,00	
Telemar	ON	42.552.547,16	
Telemar	PN	125.922.698,20	
Telesp Celular Part.	PN	27.204.255,11	
Textil/Confecção		24.799.183,11	0,92%
Coteminas	ON	18.184.498,80	
Coteminas	PN	6.614.684,31	
Total		1.540.708.354,23	
Financiamento de Projetos			
Projetos		Valor de Mercado	% s/Segmento
Marlim		29.274.421,09	1,09%
Novamarlim		76.340.207,52	2,84%
Albacora		437.908.053,32	16,30%
Total		543.522.681,93	

Fundos de Renda Variável		
Fundos de Renda Variável	Valor de Mercado	% s/Segmento
BB C. Ativa II	170.682.291,41	6,35%
Bonaire	209.403.956,21	7,80%
Brasil Private Equity	39.245.400,07	1,46%
Fiago - FCF	39.102.971,88	1,46%
Pactual Internet	6.441.540,66	0,24%
IP Seleção	29.507.650,54	1,10%
Latinvest	27.185.834,40	1,01%
Lúmina	31.123.521,12	1,16%
Sinergia	37.030.418,04	1,38%
Total	589.723.584,33	
Valores a Pagar/Receber		
Valores a Pagar	(802.305,34)	-0,03%
Valores a Receber	13.088.767,93	0,49%
Total	12.286.462,59	
Provisão para Perda		
Nenhuma		0
Total Segmento Renda Variável	2.686.241.083,08	100,00%

Composição do Segmento Renda Fixa		
Títulos Públicos		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
NTN	9.421.618.952,41	
TDA	5.797.816,53	
Moeda de Privatização	43.715.486,19	
Total	9.471.132.255,13	
Títulos Privados		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
Debêntures não Conversíveis	311.869.167,30	
Acesita	7.226.672,96	
Centro Século XXI	13.352.321,85	
Cia Energética Minas Gerais - CEMIG	51.570.070,14	
Cia Saneamento Básico Estado São Paulo - SABESP	20.130.890,89	
Cia Siderúrgica Nacional - CSN	30.136.474,36	
Concessionária Rodovia Osório Porto Alegre - CONCEPA	10.647.733,39	
CPFL Geração Energia	15.941.508,40	
Gulfshopping	30.517.335,47	
Feniciapar Leasing	3.293.977,85	
La Fonte	21.648.025,27	
Natal Shopping Center	25.047.543,37	
Paranapanema	42.478.119,93	
Playcenter	9.939.491,43	
Sernambetiba Trust SPE	8.120.487,99	
Telemar Participações	21.818.514,00	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública	141.099.959,24	
Eucatex	38.341.039,19	
Paranapanema	102.758.920,05	
Letra Hipotecária	47.612.135,28	
Caixa Economica Federal	16.738.928,27	
Banco Real	30.873.207,01	
Total	500.581.261,82	

Fundos de Renda Fixa		
Fundo	Valor de Mercado	% s/Segmento
Banco BBA S.A.	286.421.979,27	
Banco Westlb S.A.	17.949.639,20	
Banco Boston S.A.	78.427.715,09	
Banco Bradesco S.A.	617.029.294,92	
Banco Dresdner S.A.	16.703.358,43	

Banco do Brasil S.A.	201.586.391,99
Banco Santander S.A.	545.690.018,96
Banco Itau S.A.	1.072.330.646,68
Banco Safra S.A.	145.725.012,95
Banco Votorantim S.A.	37.116.396,21
Total	3.018.980.453,70
Provisão para Perda	
Grupo	Valor
FIF	2.159.797,97
Debêntures	49.579.413,04
Títulos Estaduais	68.125.236,34
CDB	1.329.356,95
Total Segmento Renda Fixa	12.990.693.970,65

Composição do Segmento Imóveis		
Grupo	Valor de Mercado	% s/Segmento
Desenvolvimento	8.828.312,38	0,95%
Aluguéis e Renda	755.723.935,71	81,51%
Fundos Imobiliários	154.678.099,41	16,68%
Outros Investimentos	7.955.350,55	0,86%
Provisão para Perda	-	0,00%
Total Segmento Imóveis	927.185.698,05	
Valores a Pagar/Receber		
Valores a Pagar	4.215.195,73	
Total	4.215.195,73	
Total Segmento Imóveis	922.970.502,32	

Composição do Segmento Empréstimos e Financiamentos			
Empréstimos			
Indexador	Atrasados	Não Atrasados	
TR	0	354.091.962,86	
Provisão para perda		0	
Financiamentos			
Indexador	Atrasados	Não Atrasados	
-	0	0	
Valores a Pagar/Receber			
Valores a Pagar		579.022,42	
Total		579.022,42	
Total Segmento Empréstimos		353.512.940,44	

Rentabilidade dos Segmentos (Modelo Cotas)

Segmento	Valor da Cota	Rentabilidade Trimestre	Benchmark	Rentabilidade Benchmark
Renda Fixa	103,51766	3,52%	CDI	4,21%
Renda Variável	100,99006	0,99%	IBOVESPA	-2,62%
Imóveis	102,13979	2,14%	IPCA+6%	3,03%
Empréstimos e Financiamentos	109,65796	9,66%	CDI	4,21%
Carteira Consolidada	103,16196	3,16%	Meta Atuarial	3,03%

Rentabilidade por Plano de Benefício (Modelo Cotas)

Plano de Benefício	Valor da Cota	Rentabilidade Trimestre	Benchmark	Rentabilidade Benchmark
Plano BD	103,16196	3,16%	Meta Atuarial	3,03%
Plano YPF	104,25049	4,25%	CDI	4,21%
Plano Cachoeira Dourada	104,07753	4,08%	CDI	4,21%
Plano Dispal	104,25048	4,25%	CDI	4,21%
Plano Transpetro	104,07755	4,08%	CDI	4,21%
Plano DBA	104,07755	4,08%	CDI	4,21%
Plano Concepa	104,07744	4,08%	CDI	4,21%

Valores em Risco (VaR)

Segmento	Método	% VaR
Renda Fixa	Paramétrico	0,005890%
Renda Variável	Paramétrico	10,6203584%

Demonstrativo dos custos incorridos com cada uma das atividades

Gestão	Consultoria de Investimentos	Custódia	Corretagens
1.131.529,00	156.874,00	512.236,45	265.707,00

Responsáveis

Nome	Tipo	Telefone	e-mail
PRICEWATERHOUSECOOPER	Auditoria	3232-6069	luiz.malzone@br.pwcglobal.com
ELIANE ALEIXO LUSTOSA	Adm. Qualificado	2506-0587	elustosa@petros.com.br

Desenquadramentos e Inobservâncias à Resolução 2829

25% da série nas aplicações em valores mobiliários de uma única companhia.		
NATAL SHOPPING CENTER S/A		87,5%
LA FONTE EMPREENDIMENTOS DE SHOPPING CENTERS		100,0%
GULFSHOPPING S/A		100,0%
25% do Patrimônio Líquido do fundo de investimento imobiliário.		
RIO OFFICE		99,4%
VIA PARQUE		44,4%

Justificativas para os Desenquadramentos e Inobservâncias à Resolução 2829

Os investimentos foram feitos antes da resolução 2829 e o enquadramento se dará conforme a resolução 2829 artigo 4º

Os resultados apurados ao final do 1º trimestre encontram-se em consonância com a Política de Investimentos