

ENCARTE ESPECIAL
DO JORNAL DA PETROS
ANO XII NÚMERO 10
OUTUBRO DE 2002

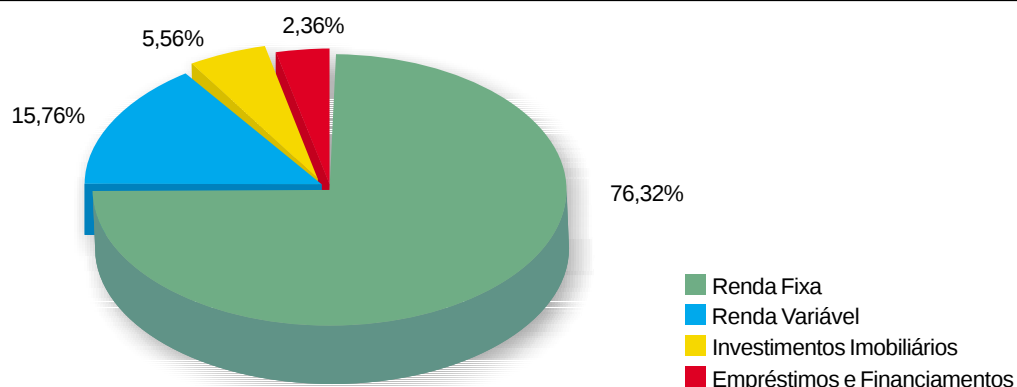


**Demonstrativo Analítico
de Investimentos e de
Enquadramento das Aplicações
DAIEA
2º Trimestre 2002**

Distribuição dos Investimentos por Segmento

Segmento	2º Trimestre de 2001		2º Trimestre de 2002	
	Valor	Percentual	Valor	Percentual
Renda Fixa	4.232.895.703,44	52,70%	12.895.590.136,93	76,32%
Renda Variável	2.573.754.769,31	32,04%	2.662.684.136,17	15,76%
Investimentos Imobiliários	919.483.595,41	11,45%	939.028.809,71	5,56%
Empréstimos e Financiamentos	305.785.524,59	3,81%	398.674.585,24	2,36%
Total dos Investimentos	8.031.919.592,75		16.895.977.668,05	

Distribuição dos Investimentos por Segmento - 2º Trimestre de 2002



Distribuição dos Investimentos por Plano

Plano de Benefício	Valor	% / Total
Plano BD		
- Renda Fixa	12.890.217.117,55	76,29%
- Renda Variável	2.662.684.136,17	15,76%
- Investimentos Imobiliários	939.028.809,71	5,56%
- Empréstimos e Financiamentos	398.674.585,24	2,36%
Plano CD		
- Renda Fixa	5.373.019,38	0,03%
- Renda Variável	0	
- Investimentos Imobiliários	0	
- Empréstimos e Financiamentos	0	

Distribuição dos Investimentos – Gestão Terceirizada

Gestor	Valor	Percentual
Banco BBA S.A.	297.935.100,76	8,54%
Banco Boston S.A.	88.962.238,49	2,55%
Banco Bradesco S.A.	691.102.213,07	19,80%
Banco Dresdner S.A.	15.389.695,37	0,44%
Banco do Brasil S.A.	154.210.193,84	4,42%
Banco Santander S.A.	562.198.718,47	16,11%
Banco Itau S.A.	996.757.831,16	28,56%

Continua

Continuação

Distribuição dos Investimentos – Gestão Terceirizada		
Gestor	Valor	Percentual
Banco Safra S.A.	105.859.023,98	3,03%
Banco Votorantim S.A.	38.492.082,10	1,10%
Mellon Brascan	380.087.757,53	10,89%
Banco CSFB S.A.	39.759.763,55	1,14%
Investidor Profissional S.A.	27.686.209,58	0,79%
Latinvest S.A.	25.425.609,60	0,73%
Dinamo S.A.	31.696.932,48	0,91%
Banco Fator S.A.	34.654.238,65	0,99%
Total	3.490.217.608,63	

Tabela Comparativa dos Limites de Alocação definidos da Res. 2829			
Segmento	Carteira	Financeiro	Porcentagem
Segmento de Renda Fixa	Renda Fixa – Baixo Risco de Crédito	12.578.303.005,87	74,45%
	Renda Fixa – Médio e Alto Risco de Crédito	409.425.283,52	2,42%
Segmento de Renda Variável	Renda Variável – Ações em Mercado	1.654.915.602,57	9,79%
	Renda Variável – Participações	1.007.768.533,60	5,96%
	Renda Variável – Outros Ativos	-	0%
Imóveis	Imóveis – Desenvolvimento	9.655.566,61	0,06%
	Imóveis – Aluguéis e Renda	754.731.672,35	4,47%
	Imóveis – Fundos Imobiliários	151.001.558,69	0,89%
	Imóveis – Outros Investimentos	23.640.012,06	0,14%
Empréstimos e Financiamentos	Empréstimos	398.674.585,24	2,36%
	Financiamentos	-	0%
Derivativos	Derivativos de Renda Fixa para Hedge	(92.138.152,46)	-0,55%
	Derivativos de R. Fixa que não é para Hedge	-	0%
	Derivativos de R. Variável para Hedge	-	0%
	Derivativos de R. Variável que não é para Hedge	-	0%
TOTAL		16.895.977.668,05	100.00%

Composição do Segmento Renda Variável		
Mercado à Vista		
Setor		Valor de Mercado % s/Segmento
Alimentos		76.796.451,56 2,96%
Perdigão	ON	33.607.903,60
Perdigão	PN	27.359.547,96
Sadia	PN	15.829.000,00
Auto Peças		5.650.000,00 0,22%
Fras-le	ON	5.650.000,00
Aviação		74.541.546,66 2,87%
Embraer	ON	12.819.435,90
Embraer	PN	61.722.110,76

Continua

Continuação

Composição do Segmento Renda Variável

Mercado à Vista

Setor		Valor de Mercado	% s/Segmento
Bancos		50.872.657,71	1,96%
Bradesco	PN	17.643.289,98	
Bradespar	PN	2.044.879,58	
Itaubanco	PN	9.034.819,04	
Itausa	PN	22.149.669,11	
Bebidas e Fumo		17.100.837,80	0,66%
Ambev	ON	17.100.837,80	
Bens de Capital		5.166.742,36	0,20%
Inepar	ON	4.241.700,99	
Inepar	PN	925.041,37	
Comunicação		77.114,16	0,00%
Gazeta Mercantil	PN	77.114,16	
Diversões e Entretenimentos		12.392.252,16	0,48%
Parque Temático Playcenter	ON	4.223.1987,71	
Parque Temático Playcenter	PN	8.169.054,45	
Energia Elétrica		162.240.701,60	6,25%
Celesc	PNB	8.248.119,13	
Cemig	ON	3.037.769,73	
Cemig	PNB	22.954.907,76	
Coelce	PNA	20.928.988,21	
Copel	ON	5.860.239,00	
Copel	PNB	20.685.413,41	
Eletrobras	ON	22.325.838,65	
Eletrobras	PNB	7.642.721,63	
Eletropaulo	PN	6.218.594,10	
GTD	ON	12.869.110,00	
GTD	PN	18.486.576,00	
Inepar Energia	ON	953.911,65	
Inepar Energia	PNA	2.775.028,47	
Light	ON	2.674.321,15	
Transm. Paulista	PN	6.579.162,71	
Mineração		77.658.905,07	2,99%
Litel	ON	803,00	
Litel	PNA	1.606,00	
Paranapanema	ON	8.647.778,49	
Vale	PNA	13.122.121,36	
Vale	PNA	55.886.596,22	
Papel Celulose		64.386.054,30	2,48%
Aracruz	PNB	1.754.742,20	
Klabin	PN	15.293.899,08	
Ripasa	PN	34.564.978,28	
Votorantim C.	PN	12.772.434,74	
Petróleo		154.713.447,22	5,96%
Petrobras	ON	40.587.552,55	
Petrobras	PN	114.125.894,67	
Química Petroquímica		12.588.821,97	0,49%
Copene	ON	12.588.821,97	

Continua

Continuação

Composição do Segmento Renda Variável		
Mercado à Vista		
Setor		Valor de Mercado % s/Segmento
Saneamento		22.886.310,70 0,88%
Sabesp ON		22.886.310,70
Serviços		3.797.678,00 0,15%
Estacion. Cinelândia ON		3.797.678,00
Siderurgia		70.510.314,89 2,72%
Acesita ON		7.854.072,95
Acesita PN		6.303.429,26
Gerdau PN		22.696.243,65
CSN ON		18.777.212,43
Sid. Tubarão PN		2.335.690,70
Usiminas PNA		12.543.665,90
Telecomunicação		582.202.986,24 22,44%
Americel ON		273.228,02
Brasil Telecom PN		51.064.464,16
Brasil Telecom ON		74.496,98
Brasil Telecom Part. ON		15.592.971,23
Brasil Telecom Part. PN		50.867.485,00
CRT Celular PNA		14.353.190,46
Embratel Part. ON		3.103.164,14
Embratel Part. PN		10.463.054,31
Globo Cabo PN		5.362.832,88
Invitel ON		27.155.547,89
Newtel ON		24.820.833,74
Recibo de Telebras PN		21.891.250,23
Tele Celular Sul ON		3.659.139,47
Tele Celular Sul PN		20.609.110,00
Tele Centro Oeste ON		8.365.173,14
Tele Leste Celular ON		779.559,41
Tele Nordeste Celular ON		3.114.650,32
Tele Nordeste Celular PN		17.190.815,00
Tele Norte Celular ON		700.119,70
Telebras PN		2.268,52
Telef. Data brasil Holding PN		158.796,63
Telemar ON		38.578.129,40
Telemar PN		178.826.277,38
Telemar NL PNA		40.177.720,78
Telemig Celular Part ON		3.982.121,17
Telesp PN		16.836.066,00
Telesp Celular Part. PN		23.599.104,18
Telet ON		601.416,10
Textil/Confecção		28.283.603,74 1,09%
Coteminas ON		21.128.878,40
Coteminas PN		7.154.725,34
Varejo		6.942.540,00 0,27%
Pão de Açúcar PN		6.942.540,00
Derivativos		5.569.842,00 0,21%
Opções Flexíveis		5.569.842,00
Total		1.434.378.808,14

Financiamento de Projetos		
Projetos	Valor de Mercado	% s/Segmento
Marlim	25.937.367,27	1,00%
Novamarlim	70.763.377,46	2,73%
Albacora	435.761.600,49	16,80%
Total	532.462.345,22	

Fundos de Renda Variável		
Fundos de Renda Variável	Valor de Mercado	% s/Segmento
Carteira Ativa II	170.699.351,54	6,58%
Bonaire	209.388.405,99	8,07%
Brasil Private Equity	39.759.763,55	1,53%
Fiago - FCF	44.116.313,13	1,70%
Pactual Internet	6.498.436,50	0,25%
IP Seleção	27.686.209,58	1,07%
Latinvest Seleção	25.425.609,60	0,98%
Lúmina	31.696.932,48	1,22%
Sinergia	34.654.238,65	1,34%
Total	589.925.261,02	
Valores a Pagar/Receber		
Valores a Pagar	(16.319.160,85)	-0,63%
Valores a Receber	53.510.687,45	2,06%
Total	37.191.526,60	
Provisão para Perda		
Nenhuma	0	
Total Segmento Renda Variável	2.593.957.940,98	100,00%

Composição do Segmento Renda Fixa		
Títulos Públicos		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
NTN	9.477.797.526,00	73,11%
CFT	9.161.305,43	0,07%
TDA	6.114.113,76	0,05%
Moeda de Privatização	45.591.166,45	0,35%
Total	9.538.667.111,64	

Títulos Privados		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
Debêntures não Conversíveis	331.025.822,89	2,55%
Acesita	6.905.650,61	
Centro Século XXI	13.637.467,81	
Cia Energética Minas Gerais . CEMIG	54.661.859,68	
Cia Saneamento Básico Estado São Paulo . SABESP	20.129.543,16	
Cia Siderúrgica Nacional . CSN	31.962.510,40	
Concessionária Rodovia Osório Porto Alegre . CONCEPA	10.947.549,35	
Copel	32.142.842,57	
CPFL Geração Energia	15.091.005,99	
Gulfshopping	31.375.127,43	
Feniciapar Leasing	3.439.434,62	
La Fonte	22.164.555,05	
Natal Shopping Center	25.768.833,78	
Paranapanema	43.765.197,03	

Continua

Continuação

Títulos Privados		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
Playcenter	10.385.768,85	
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.	297.935.100,76	2,30%
Banco Boston S.A.	88.962.238,49	0,69%
Banco Bradesco S.A.	691.102.213,07	5,33%
Banco Dresdner S.A.	15.389.695,37	0,12%
Banco do Brasil S.A.	154.210.193,84	1,19%
Banco Santander S.A.	518.082.405,34	4,00%
Banco Itau S.A.	996.757.831,16	7,69%
Banco Votorantim S.A.	38.492.082,10	0,30%
Banco Safra S.A.	105.859.023,98	0,82%
Total	2.906.790.784,11	

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	12.964.316.332,13	100,00%

Composição do Segmento Imóveis		
Grupo	Valor de Mercado	% s/Segmento
Desenvolvimento	9.655.566,61	1,03%
Aluguéis e Renda	754.731.672,35	80,35%
Fundos Imobiliários	151.233.272,46	16,10%
Outros Investimentos	23.640.012,06	2,52%
Provisão para Perda	-	0,00%
Total Segmento Imóveis	939,260,523,48	
Valores a Pagar/Receber		
Valores a Pagar	(231.713,77)	
Total	(231.713,77)	
Total Segmento Imóveis	939.028.809,71	

Composição do Segmento Empréstimos e Financiamentos				
Empréstimos				
Indexador	Atrasados		Não Atrasados	
TR	0		399.485.925,47	
Provisão para perda			0	

Continua

Continuação

Composição do Segmento Empréstimos e Financiamentos

Financiamentos			
Indexador	Atrasados		Não Atrasados
-	0		0
Valores a Pagar/Receber			
Valores a Pagar			(811.340,23)
Total			(811.340,23)
Total Segmento Empréstimos			398.674.585,24

Rentabilidade dos Segmentos (Modelo Cotas)

Segmento	Rent. Trimestre	Benchmark	Rent. Benchmark
Renda Fixa	3.24%	CDI	4.25%
Renda Variável	-3.82%	IBOVESPA	-16.29%
Imóveis	2.23%	IPCA+6%	3.11%
Empréstimos e Financiamentos	12.47%	CDI	4.25%
Carteira Consolidada	2.29%	Meta Atuarial	3.11%

Rentabilidade por Plano de Benefício (Modelo Cotas)

Plano de Benefício	Rent. Trimestre	Benchmark	Rent. Benchmark
Plano BD	2.29%	Meta Atuarial	3.11%
Plano YPF	4.01%	CDI	4.25%
Plano Cachoeira Dourada	3.07%	CDI	4.25%
Plano Dispal	4.01%	CDI	4.25%
Plano Transpetro	3.07%	CDI	4.25%
Plano DBA	3.07%	CDI	4.25%
Plano Petromarketing	3.07%	CDI	4.25%
Plano Satélite	3.07%	CDI	4.25%
Plano Concepa	3.07%	CDI	4.25%

Valores em Risco (VaR)

Segmento	Método	% VaR
Renda Fixa	Paramétrico	1,318107%
Renda Variável	Paramétrico	7,003329%

Demonstrativo dos custos incorridos com cada uma das atividades

Gestão	Consultoria de Investimentos	Custódia	Corretagens
1.248.262,21	92.488,82	651.839,65	447.343,49

Responsáveis

Nome	Tipo	Telefone	e-mail
PRICEWATERHOUSECOOPERS	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 2º trimestre encontram-se em consonância com a Política de Investimentos
 – A Carteira de Participações apresenta redução de R\$ 341 milhões em relação ao 1º trimestre, pois refizemos a classificação de alguns investimentos em conformidade com o artigo 21 da Resolução 2829/2850. Esse valor agora está classificado na categoria Ações em Mercado.