

ENCARTE ESPECIAL
DO JORNAL DA PETROS
ANO XII - NÚMERO 1
JANEIRO DE 2003

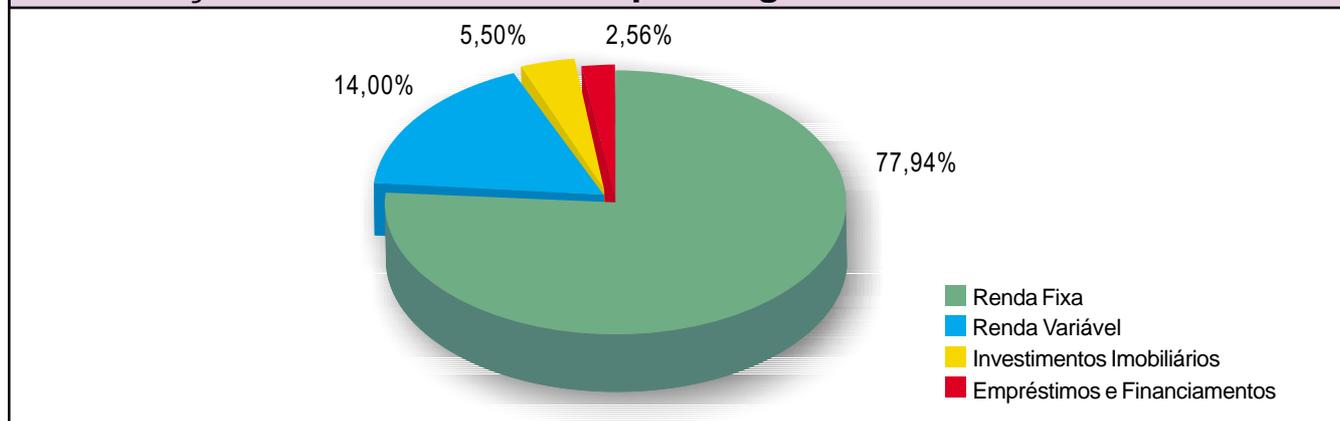


**Demonstrativo Analítico
de Investimentos e de
Enquadramento das Aplicações
DAIEA
3º Trimestre 2002**

Distribuição dos Investimentos por Segmento

Segmento	3º Trimestre de 2001		3º Trimestre de 2002	
	Valor	Percentual	Valor	Percentual
Renda Fixa	4.356.256.078,97	54,19%	13.348.733.855,98	77,94%
Renda Variável	2.426.506.816,96	30,18%	2.397.679.003,85	14,00%
Investimentos Imobiliários	920.028.718,58	11,44%	942.267.118,94	5,50%
Empréstimos e Financiamentos	337.190.631,91	4,19%	438.703.594,29	2,56%
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	8.039.982.246,42	100,00%	17.127.383.573,06	100,00%

Distribuição dos Investimentos por Segmento - 3º Trimestre de 2002



Distribuição dos Investimentos por Plano

Plano de Benefício	Valor	% / Total
Plano BD		
- Renda Fixa	13.341.900.136,81	77,90%
- Renda Variável	2.397.679.003,85	14,00%
- Investimentos Imobiliários	942.267.118,94	5,50%
- Empréstimos e Financiamentos	438.703.594,29	2,56%
Plano CD		
- Renda Fixa	6.833.719,17	0,04%
- Renda Variável	0	
- Investimentos Imobiliários	0	
- Empréstimos e Financiamentos	0	

Distribuição dos Investimentos – Gestão Terceirizada

Gestor	Valor	Percentual
Banco BBA S.A.	315.489.846,53	9,03%
Banco Boston S.A.	107.770.755,45	3,08%
Banco Bradesco S.A.	751.811.655,04	21,52%
Banco do Brasil S.A.	106.688.198,44	3,05%
Banco Santander S.A.	583.684.268,46	16,71%
Banco Itau S.A.	948.498.121,23	27,16%
Banco Safra S.A.	104.559.303,67	2,99%

Continua

Continuação

Distribuição dos Investimentos – Gestão Terceirizada		
Gestor	Valor	Percentual
Banco Votorantim S.A.	40.085.034,54	1,15%
Banco CSFB S.A.	35.081.066,14	1,00%
Banco Mellon S.A.	380.073.780,52	10,88%
Investidor Profissional S.A.	26.057.215,91	0,75%
Banco Pactual S.A.	9.891.432,50	0,28%
Latinvest S.A.	20.601.856,80	0,59%
Dinamo S.A.	32.661.609,60	0,93%
Banco Fator S.A.	30.654.078,03	0,88%
TOTAL	3.493.608.222,86	100,00%

Tabela Comparativa dos Limites de Alocação Definidos da Res. CMN 2829			
Segmento	Carteira	Financeiro	Porcentagem
Segmento de Renda Fixa	Renda Fixa – Baixo Risco de Crédito	13.036.308.433,89	76,11%
	Renda Fixa – Médio e Alto Risco de Crédito	380.392.870,98	2,22%
Segmento de Renda Variável	Renda Variável – Ações em Mercado	1.614.829.610,72	9,43%
	Renda Variável – Participações	782.849.393,13	4,57%
	Renda Variável – Outros Ativos	-	0%
Imóveis	Imóveis – Desenvolvimento	10.662.754,18	0,06%
	Imóveis – Aluguéis e Renda	754.792.734,82	4,41%
	Imóveis – Fundos Imobiliários	152.292.188,48	0,89%
	Imóveis – Outros Investimentos	24.519.441,46	0,14%
Empréstimos e Financiamentos	Empréstimos	438.703.594,29	2,56%
	Financiamentos	-	0%
Derivativos	Derivativos de Renda Fixa para Hedge	(67.967.448,89)	-0,40%
	Derivativos de Renda Fixa que não é para Hedge	-	0%
	Derivativos de Renda Variável para Hedge	-	0%
	Derivativos de Renda Variável que não é para Hedge	-	0%
TOTAL		17.127.383.573,06	100,00%

Composição do Segmento Renda Variável			
Mercado à Vista			
Setor		Valor de Mercado	% s/Segmento
Alimentos		72.248.636,66	3,01%
Perdigão	ON	33.833.460,00	
Perdigão	PN	21.072.186,66	
Sadia	PN	17.342.990,00	
Auto Peças		6.390.150,00	0,27%
Fras-le	ON	6.390.150,00	
Aviação		71.053.387,02	2,96%
Embraer	ON	12.828.336,00	
Embraer	PN	58.225.051,02	
Bancos		42.345.319,10	1,77%
Bradesco	PN	17.532.388,96	
Bradespar	PN	1.590.402,01	
Itaubanco	PN	6.552.230,20	
Itausa	PN	16.670.297,93	

Continua

Continuação

Composição do Segmento Renda Variável

Mercado à Vista

Setor		Valor de Mercado	% s/Segmento
Bebidas e Fumo		25.378.656,76	1,06%
Ambev	ON	17.559.923,76	
Ambev	PN	7.818.733,00	
Bens de Capital		3.381.303,17	0,14%
Inepar	ON	2.210.844,82	
Inepar	PN	1.170.458,35	
Comunicação		77.611,67	0,00%
Gazeta Mercantil	PN	77.611,67	
Diversões e Entretenimentos		7.994.739,97	0,33%
Parque Temático Playcenter	ON	2.724.554,59	
Parque Temático Playcenter	PN	5.270.185,38	
Energia Elétrica		128.081.343,97	5,34%
Celesc	PNB	7.166.342,00	
Cemig	ON	2.007.612,36	
Cemig	PN	20.416.971,80	
Comgas	PNA	1.785.154,80	
Coelce	PNA	13.615.733,81	
Copel	ON	3.804.108,00	
Copel	PNB	16.537.000,00	
Eletrobras	ON	12.613.752,00	
Eletrobras	PNB	5.069.212,53	
Eletropaulo	PN	3.354.966,83	
GTD	ON	12.869.110,00	
GTD	PN	18.486.576,00	
Inepar Energia	ON	1.017.505,76	
Inepar Energia	PNA	2.336.866,08	
Light	ON	1.712.432,00	
Transm. Paulista	PN	5.288.000,00	
Mineração		50.193.032,08	2,09%
Litel	ON	1.017,98	
Litel	PNA	2.035,97	
Paranapanema	ON	270.963,73	
Caemi Metalúrgica	PN	13.523.914,40	
Vale	PNA	36.395.100,00	
Papel Celulose		60.143.284,74	2,51%
Aracruz	PNB	6.555.080,00	
Klabin	PN	6.844.231,08	
Ripasa	PN	32.617.655,56	
Votorantim C.	PN	14.126.318,10	
Petróleo		105.613.001,61	4,40%
Petrobras	ON	14.705.829,51	
Petrobras	PN	90.907.172,10	
Química Petroquímica		12.940.051,95	0,54%
Brasken	ON	12.940.051,95	
Saneamento		21.317.282,75	0,89%
Sabesp	ON	21.317.282,75	
Serviços		4.403.610,00	0,18%
Estacion. Cinelândia	ON	4.403.610,00	

Continua

Continuação

Composição do Segmento Renda Variável			
Mercado à Vista			
Setor		Valor de Mercado	% s/Segmento
Siderurgia		65.603.960,51	2,74%
Acesita	ON	7.140.066,32	
Acesita	PN	5.795.028,76	
Gerdau	PN	18.580.761,43	
CSN	ON	6.486.480,00	
Sid. Tubarão	PN	18.706.084,00	
Usiminas	PNA	8.895.540,00	
Telecomunicação		513.697.899,00	21,42%
Americel	ON	-	
Brasil Telecom	PN	46.944.540,00	
Brasil Telecom Part.	ON	12.966.532,98	
Brasil Telecom Part.	PN	32.380.446,58	
CRT Celular	PNA	11.274.467,82	
Embratel Part.	ON	2.283.977,79	
Embratel Part.	PN	13.978.475,64	
Globo Cabo	PN	739.850,00	
Invitel	ON	24.153.635,03	
Newtel	ON	21.522.140,05	
Recibo de Telebras	PN	22.685.233,40	
Tele Celular Sul	ON	3.191.196,22	
Tele Celular Sul	PN	22.164.082,32	
Tele Centro Oeste	ON	7.517.351,54	
Tele Centro Oeste	PN	2.879.688,00	
Tele Leste Celular	ON	490.008,77	
Tele Nordeste Celular	ON	3.489.622,69	
Tele Nordeste Celular	PN	18.974.591,00	
Tele Norte Celular	ON	308.052,67	
Telebras	PN	2.268,52	
Telef. Data brasil Holding	PN	81.666,84	
Telemar	ON	26.227.872,57	
Telemar	PN	140.965.477,51	
Telemar NL	PNA	35.624.179,67	
Telemig Celular Part.	ON	2.908.370,64	
Telemig Celular Part.	PN	10.499.992,00	
Telesp	PN	17.930.471,00	
Telesp Celular Part.	PN	31.513.707,75	
Telet	ON	-	
Textil / Confecção		33.875.810,30	1,41%
Coteminas	ON	20.780.800,00	
Coteminas	PN	13.095.010,30	
Varejo		3.552.874,60	0,15%
Pão de Açúcar	PN	3.552.874,60	
Derivativos		29.449.607,70	1,23%
Opções Flexíveis		29.449.607,70	
TOTAL		1.257.741.563,56	52,44%
Marlim		27.248.239,57	1,14%
Novamarlim		74.246.421,87	3,10%
Albacora		440.985.620,69	18,39%
TOTAL		542.480.282,13	22,63%

Fundos de Renda Variável		
Fundos de Renda Variável	Valor de Mercado	% s/Segmento
Carteira Ativa II	170.687.000,43	7,12%
Bonaire	209.386.780,09	8,73%
Brasil Private Equity	35.081.066,14	1,46%
Fiago - FCF	44.109.702,90	1,84%
Pactual Internet	9.891.432,50	0,41%
IP Seleção	26.057.215,91	1,09%
Latinvest Seleção	20.601.856,80	0,86%
Lúmina	32.661.609,60	1,36%
Sinergia	30.654.078,03	1,28%
TOTAL	579.130.742,40	24,15%

Valores a Pagar/Receber		
Valores a Pagar	(6.301.561,30)	-0,26%
Valores a Receber	24.627.977,06	1,03%
TOTAL	18.326.415,76	

Provisão para Perda		
Nenhuma	0	
TOTAL SEGMENTO RENDA VARIÁVEL	2.397.679.003,85	100,00%

Composição do Segmento Renda Fixa		
Títulos Públicos		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
NTN	9.837.014.200,25	73,70%
CFT	9.651.978,17	0,07%
TDA	6.461.185,59	0,05%
Moeda de Privatização	49.479.528,27	0,37%
TOTAL	9.902.606.892,28	74,19%

Títulos Privados		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
Debêntures não Conversíveis	341.301.991,80	2,56%
Acesita	7.241.628,67	
Cia Energética Minas Gerais - CEMIG	60.282.116,68	
Cia Saneamento Básico Estado São Paulo - SABESP	20.140.898,63	
Cia Siderúrgica Nacional - CSN	35.298.955,07	
Concessionária Rodovia Osório Porto Alegre - CONCEPA	11.715.150,60	
Copel	35.498.111,41	
CPFL Geração Energia	16.597.026,47	
Gulfshopping	33.539.269,60	
Feniciapar Leasing	3.604.076,70	
La Fonte	23.536.943,36	
Natal Shopping Center	27.631.961,06	
Paranapanema	45.643.281,19	
Playcenter	10.988.296,03	
Sernambetiba Trust SPE	9.584.276,33	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública	153.824.089,68	1,15%
Eucatex	43.425.571,52	
Paranapanema	110.398.518,16	

Continua

Continuação

Composição do Segmento Renda Fixa		
Títulos Privados		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
Letra Hipotecária	36.523.401,76	0,27%
Caixa Economica Federal	18.392.124,64	
Banco Real	18.131.277,12	
TOTAL	531.649.483,24	

Fundos de Renda Fixa		
Fundo	Valor de Mercado	% s/Segmento
Banco BBA S.A.	315.489.846,53	2,36%
Banco Boston S.A.	107.770.755,45	0,81%
Banco Bradesco S.A.	751.811.655,04	5,63%
Banco do Brasil S.A.	106.688.198,44	0,80%
Banco Santander S.A.	539.574.565,56	4,04%
Banco Itau S.A.	948.498.121,23	7,11%
Banco Votorantim S.A.	104.559.303,67	0,78%
Banco Safra S.A.	40.085.034,54	0,30%
TOTAL	2.914.477.480,46	

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	
Valores a Pagar/Receber		
Valores a Pagar	-	
TOTAL	-	
TOTAL SEGMENTO IMÓVEIS	13.348.733.855,98	100,00%

Composição do Segmento Imóveis		
Grupo	Valor de Mercado	% s/Segmento
Desenvolvimento	10.662.754,18	1,3%
Aluguéis e Renda	754.792.734,82	80,10%
Fundos Imobiliários	152.292.188,48	16,16%
Outros Investimentos	24.519.411,46	2,60%
Provisão para Perda	-	0,00%
TOTAL SEGMENTO IMÓVEIS	942.267.118,94	
Valores a Pagar/Receber		
Valores a Pagar	(3.442.311,15)	
Valores a Receber	5.215.147,62	
TOTAL	(3.442.311,15)	
TOTAL SEGMENTO IMÓVEIS	938.824.807,79	

Composição do Segmento Empréstimos e Financiamentos			
Empréstimos			
Indexador	Atrasados	Não Atrasados	
TR	0	438.703.594,29	
Provisão para perda		0	

Continua

Continuação

Financiamentos		
Indexador	Atrasados	Não Atrasados
-	0	0
Valores a Pagar/Receber		
Valores a Pagar		(2.991.559,72)
Valores a Receber		266.570,92
TOTAL		(2.724.988,80)
TOTAL SEGMENTO EMPRÉSTIMOS		435.712.034,57

Rentabilidade dos Segmentos (Modelo Cotas)			
Segmento	Rent. Trimestre	Benchmark	Rent. Benchmark
Renda Fixa	4,47%	CDI	4,42%
Renda Variável	-7,34%	IBOVESPA	-23,55%
Imóveis	2,32%	IPCA+6%	3,78%
Empréstimos e Financiamentos	7,50%	CDI	4,42%
Carteira Consolidada	2,62%	Meta Atuarial	3,78%

Rentabilidade por Plano de Benefício (Modelo Cotas)			
Plano de Benefício	Rent. Trimestre	Benchmark	Rent. Benchmark
Plano BD	2,62%	Meta Atuarial	3,78%
Plano YPF	4,54%	CDI	4,42%
Plano Cachoeira Dourada	4,54%	CDI	4,42%
Plano Dispal	4,54%	CDI	4,42%
Plano Transpetro	4,54%	CDI	4,42%
Plano DBA	4,54%	CDI	4,42%
Plano Petromarketing	4,54%	CDI	4,42%
Plano Satélite	4,54%	CDI	4,42%
Plano Concepa	4,54%	CDI	4,42%

Valores em Risco (VaR)		
Segmento	Método	% VaR
Renda Fixa	Não Paramétrico	0,684558%
Renda Variável	Não Paramétrico	10,793503%

Demonstrativo dos custos incorridos com cada uma das atividades			
Gestão	Consultoria de Investimentos	Custódia	Corretagens
917.588,20	72.582,00	394.812,49	323.795,98

Nome	Responsáveis			e-mail
	Tipo	Telefone		
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