

• ENCARTE DO
INFORMATIVO
DA PETROS –
FUNDAÇÃO
PETROBRAS
DE SEGURIDADE
SOCIAL
• NÚMERO 6
• OUTUBRO 2005

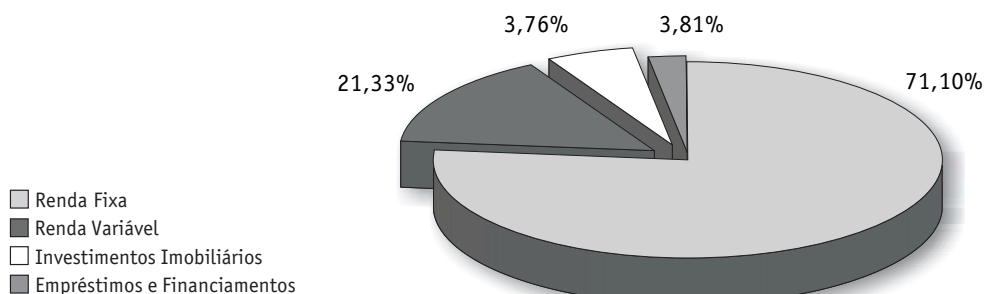


*DEMONSTRATIVO ANALÍTICO
DE INVESTIMENTOS E
ENQUADRAMENTO DAS
APLICAÇÕES – DAIEA*

2º TRIMESTRE DE 2005

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO				
Segmento	2º Trimestre de 2004		2º Trimestre de 2005	
	Valor	Percentual	Valor	Percentual
Renda Fixa	16.452.908.473,52	72,26%	18.444.658.247,79	71,10%
Renda Variável	4.537.689.638,50	19,93%	5.532.384.046,64	21,33%
Investimentos Imobiliários	945.464.952,18	4,15%	976.432.935,15	3,76%
Empréstimos e Financiamentos	832.914.093,34	3,66%	988.208.034,99	3,81%
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	22.768.977.157,54	100,00%	25.941.683.264,57	100,00%

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO - 2º TRIMESTRE DE 2005



DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR PLANO		
Plano de Benefício	Valor	Percentual
Plano BD		
- Renda Fixa	18.403.220.962,64	70,94%
- Renda Variável	5.532.384.046,64	21,33%
- Investimentos Imobiliários	976.432.935,15	3,76%
- Empréstimos e Financiamentos	988.208.034,99	3,81%
Plano CD		
- Renda Fixa	41.437.285,15	0,16%
- Renda Variável	0	
- Investimentos Imobiliários	0	
- Empréstimos e Financiamentos	0	

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS – GESTÃO TERCEIRIZADA		
Gestor	Valor	Percentual
Banco Itau S.A.	326.803.043,49	4,99%
Banco CSFB S.A.	65.546.868,91	1,00%
Mellon Serv. Financeiro LTDA	1.161.460.804,97	17,74%
Banco Brascan S.A.	1.511.517,57	0,02%
Investidor Profissional S.A	101.690.042,83	1,55%
Governança e Gestão	1.853.867,24	0,03%
Banco Pactual S.A.	109.674.282,85	1,67%
Dynamo S.A	130.906.325,31	2,00%
BB DTVM	483.396.251,14	7,38%
Banco Fator S.A	43.203.711,39	0,66%

CONTINUA

CONTINUAÇÃO

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS – GESTÃO TERCEIRIZADA		
Gestor	Valor	Percentual
Banco BBM S.A.	188.344.341,39	2,88%
BankBoston Asset Management LTDA	215.191.763,85	3,29%
Bradesco Asset Management LTDA - BRAM	384.626.640,69	5,87%
HSBC Bank Brasil S.A.	215.252.342,07	3,29%
Banco Safra S.A.	188.396.619,20	2,88%
Banco Santander Brasil S.A.	162.031.600,03	2,47%
Votorantim asset Management DTVM LTDA	215.209.067,34	3,29%
BEM DTVM LTDA	2.250.474.027,41	34,37%
Maxima S.A. DTVM	101.379.190,82	1,55%
Banco BNP Paribas Brasil	101.217.505,94	1,55%
Sul America Inv. DTVM	100.517.589,30	1,53%
TOTAL	6.548.687.403,74	100,00%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA VARIÁVEL			
Mercado à Vista			
Empresas		Valor de Mercado	% s/Segmento
ACESITA	ON	46.281.901,33	0,84%
AES TIETE	PN	11.925.364,30	0,22%
ALPARGATAS	PN	20.253.155,00	0,37%
BELGO MINEIRA	PN	52.390.894,60	0,95%
BRADESCO	PN	123.368.925,12	2,23%
BRADESPAR	PN	21.705.425,00	0,39%
BRASIL TELECOM PART	ON	39.664.460,59	0,72%
BRASIL TELECOM PART	PN	33.670.531,26	0,61%
BRASIL TELECOM	PN	4.084.901,84	0,07%
BRASKEM	ON	50.074.301,18	0,91%
BRASKEM	PNA	50.058.852,00	0,90%
CEMIG	PN	139.465.702,00	2,52%
COELCE	PNA	28.301.699,97	0,51%
CONFAB	PN	49.503.728,00	0,89%
COPESUL	ON	50.758.850,00	0,92%
COTEMINAS	ON	21.560.080,00	0,39%
COTEMINAS	PN	12.937.460,67	0,23%
CRT CELULAR	PNA	4.970.728,65	0,09%
CSN	ON	81.464.924,70	1,47%
ESCELSA	ON	8.710.707,18	0,16%
ELETROBRÁS	PNB	22.882.501,65	0,41%
EMBRATEL PART	ON	63.623,00	0,00%
FRAS-LE	ON	10.170.000,00	0,18%
GAZETA MERCANTIL	PN	77.611,67	0,00%
GERDAU	PN	31.619.970,00	0,57%
GRENDENE	ON	12.112.704,00	0,22%
GTD	ON	23.164.398,00	0,42%

CONTINUA

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA VARIÁVEL			
Mercado à Vista			
Empresas		Valor de Mercado	% s/Segmento
GTD	PN	8.919.772,92	0,16%
INEPAR *	ON	0,00	0,00%
INEPAR ENERGIA	ON	1.589.852,75	0,03%
INEPAR ENERGIA	PNA	2.775.028,47	0,05%
INVITEL	ON	23.583.956,40	0,43%
ITAU BANCO	PN	178.793.841,60	3,23%
ITAUSA	PN	114.693.474,09	2,07%
LITEL	ON	803,00	0,00%
LITEL	PNA	1.604,54	0,00%
LOJAS AMERICANAS	ON	5.840.407,00	0,11%
LOJAS AMERICANAS	PN	73.465.616,96	1,33%
METALÚRGICA GERDAU	PN	65.975.330,00	1,19%
NEWTEL	ON	23.291.362,80	0,42%
PÃO DE AÇUCAR	PN	2.070.756,00	0,04%
PARANAPANEMA	ON	12.942.838,08	0,23%
PERDIGAO	ON	103.755.944,00	1,88%
PERDIGAO	PN	174.580.950,35	3,16%
PETROBRAS	ON	168.146.966,70	3,04%
PETROBRAS	PN	429.714.647,20	7,77%
PETROBRAS IPIRANGA	PN	26.893.150,00	0,49%
PQ. HOPI HARI *	ON	0,00	0,00%
PQ. HOPI HARI *	PN	0,00	0,00%
RIPASA	PN	81.300.723,56	1,47%
SABESP	ON	64.322.430,73	1,16%
SADIA	PN	46.166.506,99	0,83%
SID. TUBARAO	PN	29.048.125,20	0,53%
SOUZA CRUZ	ON	17.420.016,00	0,31%
SUZANO PETROQUÍMICA	PN	8.533.430,48	0,15%
TEL. DATA BRASIL	ON	335,94	0,00%
TEL. DATA BRASIL	PN	111.960,62	0,00%
TELE NORTE CELULAR	ON	696,46	0,00%
TELE NORTE CELULAR	PN	491,62	0,00%
TELE NORTE LESTE	ON	96.403.011,60	1,74%
TELE NORTE LESTE	PN	100.002.124,89	1,81%
TELEBRAS	ON	40,97	0,00%
TELEBRAS	PN	11.424,56	0,00%
TELEBRAS RECIBO	PN	15.879.663,38	0,29%
TELEMAR NL	PNA	52.836.333,15	0,96%
TELEMIG CEL PART	ON	9.086.894,44	0,16%
TELEMIG CEL PART	PN	2.018.543,83	0,04%
TELESP	ON	29.860,74	0,00%
TELESP	PN	33.759.293,40	0,61%

CONTINUA

CONTINUAÇÃO

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA VARIÁVEL			
Mercado à Vista			
Empresas		Valor de Mercado	% s/Segmento
TIM PARTICIPAÇÕES	ON	6.691,47	0,00%
TIM PARTICIPAÇÕES	PN	3.848.679,32	0,07%
TRACTEBEL ENERGIA	ON	17.411.297,12	0,31%
TRAN PAULISTA	PN	39.509.157,41	0,71%
ULTRAPAR	PN	33.178.821,68	0,60%
USIMINAS	PNA	58.832.696,00	1,06%
VALE	PNA	270.332.300,00	4,89%
VALE	ON	115.109.550,00	2,08%
VOTORANTIM C. PAPEL	PN	21.427.547,43	0,39%
WEG	PN	36.842.520,00	0,67%
TOTAL		3.521.710.873,56	63,66%

FINANCIAMENTO DE PROJETOS			
Projetos		Valor de Mercado	% s/Segmento
Marlim		13.858.745,04	0,25%
Novamarlim		63.293.353,51	1,14%
Estacionamento Cinelândia		5.714.030,00	0,10%
Termobahia		66.956.449,55	1,21%
Albacora		285.967.054,60	5,17%
Clep		31.626.000,00	0,57%
TOTAL		467.415.632,70	8,45%

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL		
Fundos de Renda Variável	Valor de Mercado	% s/Segmento
Carteira Ativa II	845.776.311,35	15,29%
Bonaire	281.775.770,24	5,09%
Brasil Private Equity	65.546.868,91	1,18%
Fiago - FCF	33.908.723,38	0,61%
FIP Gov. e Gestão	1.853.867,24	0,03%
Pactual Internet	8.288.546,19	0,15%
Petróleo e Gás	1.511.517,57	0,03%
IP Seleção	101.690.042,83	1,84%
Lúmina	121.848.757,71	2,20%
Sinergia	43.203.711,39	0,78%
Br.Energia	9.506.433,07	0,17%
Excelencia Social	4.114.433,10	0,07%
Puma II	9.057.567,60	0,16%
TOTAL	1.528.082.550,58	27,62%
VALORES A PAGAR/RECEBER		
Valores a Pagar	(132,46)	0,00%
Valores a Receber	15.175.122,26	0,27%
TOTAL	15.174.989,80	
TOTAL SEGMENTO RENDA VARIÁVEL	5.532.384.046,64	100,00%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA FIXA		
Títulos Públicos		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
NTN	12.727.146.805,83	69,00%
CFT	13.819.019,06	0,07%
TDAE	5.667.728,20	0,03%
TOTAL	12.746.633.553,09	69,11%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA FIXA		
Títulos Privados		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
Debêntures não Conversíveis	291.765.232,85	1,58%
Cia Energética Minas Gerais - CEMIG	82.459.576,09	
Cia Saneamento Básico Estado São Paulo - SABESP	10.083.762,63	
Cia Vale do Rio Doce	137.203,81	
Concessionária Rodovia Osório Porto Alegre - CONCEPA	8.261.604,14	
Copel	48.517.045,60	
CPFL Geração Energia	22.769.947,05	
Gulfshopping	47.311.496,96	
La Fonte	33.473.645,48	
Natal Shopping Center	38.750.951,09	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública	87.077.814,81	0,47%
Paranapanema	87.077.814,81	
Letra Hipotecária	23.559.970,53	0,13%
Caixa Economica Federal	23.559.970,53	
Certificado de Recebíveis Imobiliários	72.429.154,38	0,39%
Hospital da Bahia	33.142.117,66	
C-Mac Brasil	2.147.269,50	
Cometa	20.971.768,54	
Boa Viagem Medical	10.736.102,18	
Facamp	5.431.896,50	
Fundo de Investimento em Direitos Creditórios	200.105.517,47	1,08%
RURAL	26.042.948,33	
RB Fiducia	10.195.245,70	
BMG	78.096.240,38	
BANCOOP I	11.510.041,87	
ASM FCVS	74.261.041,19	
TOTAL	674.937.690,04	2,57%

FUNDOS DE RENDA FIXA		
Fundo	Valor de Mercado	% s/Segmento
FIC de FIM Madson	82.702,96	0,00%
FIC de FIM Petros Crédito	1.341.409.985,18	7,27%
FIC de FIM Petros Moderado	2.365.836.241,83	12,83%
FIC de FIM Renda Fixa Liquidez	908.771.600,84	4,93%
FIC de FIM Multicarteira	404.500.103,42	2,19%
TOTAL	5.020.600.634,23	27,23%

CONTINUA

CONTINUAÇÃO

PROVISÃO PARA PERDA		
Grupo	Valor	
FIF	2.159.797,97	
Debêntures	234.210.677,80	
Títulos Estaduais	68.125.236,34	
CDB	1.329.356,95	
VALORES A PAGAR / RECEBER		
Valores a Pagar/Receber	2.486.370,43	
TOTAL	2.486.370,43	
TOTAL SEGMENTO RENDA FIXA	18.444.658.247,79	98,91%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO IMÓVEIS		
Grupo	Valor de Mercado	% s/Segmento
Desenvolvimento	-	0,00%
Aluguéis e Renda	790.698.691,39	80,82%
Fundos Imobiliários	162.555.394,13	16,62%
Outros Investimentos	25.061.659,15	2,56%
Provisão para Perda	-	0,00%
TOTAL SEGMENTO IMÓVEIS	978.315.744,67	
VALORES A PAGAR/RECEBER		
Valores a Pagar	(1.882.809,52)	
Valores a Receber	-	
TOTAL	(1.882.809,52)	
TOTAL SEGMENTO IMÓVEIS	976.432.935,15	100,00%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS			
Empréstimos			
Indexador	Atrasados	Não Atrasados	
TR	0	996.797.811,78	
Provisão para perda		-	
Financiamentos			
Indexador	Atrasados	Não Atrasados	
-	0	0	
VALORES A PAGAR/RECEBER			
Valores a Pagar		(8.589.776,79)	
Valores a Receber		-	
TOTAL		(8.589.776,79)	
TOTAL SEGMENTO EMPRÉSTIMOS		988.208.034,99	

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS (MODELO COTAS)			
Segmento	Rentabilidade Trimestre	Benchmark	Rentabilidade Benchmark
Renda Fixa	3,59%	CDI	4,56%
Renda Variável	-1,79%	IBX-50	-3,46%
Imóveis	4,39%	IPCA+6%	1,84%
Empréstimos e Financiamentos	4,56%	IPCA+6%	1,84%

DEMONSTRATIVO DOS CUSTOS INCORRIDOS COM CADA UMA DAS ATIVIDADES				
Gestão	Consultoria de Investimentos	Custódia	Corretagens	Outros
835.726,05	28.411,31	60.539,25	122.334,30	522.214,02

RESPONSÁVEIS			
Nome	Tipo	Telefone	e-mail
TREVISAN AUDITORES INDEPENDENTES	Auditoria	2509-9627	gurgel@trevisan.com.br
RICARDO MALAVAZI	Adm. Qualificado	2506-0587	malavazi@petros.com.br

DESENQUADRAMENTOS E INOBSERVÂNCIAS À RESOLUÇÃO CMN Nº 3121/03	
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	99,40%
JUSTIFICATIVAS PARA OS DESENQUADRAMENTOS E INOBSERVÂNCIAS À RESOLUÇÃO CMN Nº 3121/03	
O enquadramento dos investimentos se dará conforme artigo 4º da resolução CMN nº 3121/03	