

• INFORMATIVO
DA PETROS –
FUNDAÇÃO
PETROBRAS
DE SEGURIDADE
SOCIAL
• NÚMERO 3
• JANEIRO 2006



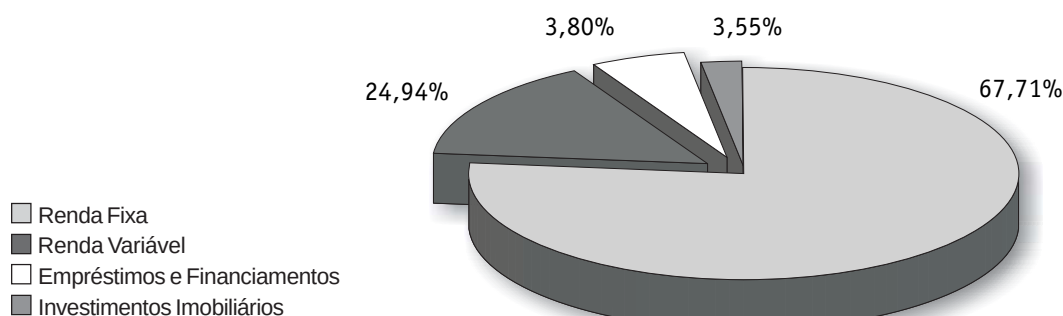
*DEMONSTRATIVO ANALÍTICO
DE INVESTIMENTOS E
ENQUADRAMENTO DAS
APLICAÇÕES – DAIEA*

3º TRIMESTRE DE 2005

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	3º Trimestre de 2004		3º Trimestre de 2005	
	Valor	Percentual	Valor	Percentual
Renda Fixa	16.837.948.820,13	72,26%	18.508.173.416,06	67,71%
Renda Variável	5.309.558.647,69	19,93%	6.818.093.412,63	24,94%
Investimentos Imobiliários	957.704.952,20	4,15%	969.703.545,08	3,55%
Empréstimos e Financiamentos	861.328.844,31	3,66%	1.039.029.089,36	3,80%
Total dos Investimentos	23.966.541.264,33	100,00%	27.334.999.463,13	100,00%

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO - 3º TRIMESTRE DE 2005



DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR PLANO

Plano de Benefício	Valor	Percentual
Plano BD		
- Renda Fixa	18.460.317.630,33	67,53%
- Renda Variável	6.818.093.412,63	24,94%
- Investimentos Imobiliários	969.703.545,08	3,55%
- Empréstimos e Financiamentos	1.039.029.089,36	3,80%
Plano CD		
- Renda Fixa	47.855.785,73	0,18%
- Renda Variável	0	
- Investimentos Imobiliários	0	
- Empréstimos e Financiamentos	0	

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS – GESTÃO TERCEIRIZADA

Gestor	Valor	Percentual
Banco Itau S.A.	343.140.071,28	5,26%
Banco CSFB S.A.	90.201.327,19	1,38%
Mellon Serv. Financeiro LTDA	1.161.799.573,42	17,82%
Banco Brascan S.A.	1.574.578,84	0,02%
Investidor Profissional S.A	116.201.395,26	1,78%
Governança e Gestão	1.689.216,43	0,03%
Banco Pactual S.A.	123.476.554,71	1,89%
Dynamo S.A	172.839.023,94	2,65%
BB DTVM	505.369.732,01	7,75%
Banco Fator S.A	48.090.835,57	0,74%
Banco BBM S.A.	197.562.571,02	3,03%

CONTINUA

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS – GESTÃO TERCEIRIZADA		
Gestor	Valor	Percentual
BankBoston Asset Management LTDA	225.210.864,83	3,45%
Bradesco Asset Management LTDA - BRAM	391.157.002,74	6,00%
HSBC Bank Brasil S.A.	225.410.803,63	3,46%
Banco Safra S.A.	197.380.022,30	3,03%
Banco Santander Brasil S.A.	169.673.460,30	2,60%
Votorantim asset Management DTVM LTDA	225.455.962,64	3,46%
BEM DTVM LTDA	2.008.031.786,73	30,79%
Maxima S.A. DTVM	106.034.568,19	1,63%
Banco BNP Paribas Brasil	105.717.860,47	1,62%
Sul America Inv. DTVM	104.778.859,88	1,61%
TOTAL	6.520.796.071,38	100,00%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA VARIÁVEL			
Mercado à Vista			
Empresas		Valor de Mercado	% s/Segmento
ACESITA	ON	50.480.259,55	0,74%
AES TIETE	PN	13.107.412,54	0,19%
ALPARGATAS	PN	20.024.400,00	0,29%
AMBEV	PN	108.633.168,00	1,59%
ARACRUZ	PNB	7.807.488,00	0,11%
BELGO MINEIRA	PN	73.047.982,10	1,07%
BRADESCO	PN	309.816.774,72	4,54%
BRADSPAR	PN	43.930.656,00	0,64%
BRASIL TELECOM PART	ON	50.617.049,55	0,74%
BRASIL TELECOM PART	PN	37.261.982,06	0,55%
BRASIL TELECOM	PN	4.295.213,62	0,06%
BRASKEM	ON	55.072.858,12	0,81%
BRASKEM	PNA	30.284.844,00	0,44%
CEMIG	PN	188.249.411,89	2,76%
COELCE	PNA	36.863.558,78	0,54%
CONFAB	PN	41.711.096,00	0,61%
CONTAX	ON	3.517.236,03	0,05%
CONTAX	PN	3.477.260,24	0,05%
COPESUL	ON	37.801.896,00	0,55%
COTEMINAS	ON	22.079.600,00	0,32%
COTEMINAS	PN	12.917.843,60	0,19%
CRT CELULAR	PNA	5.333.469,04	0,08%
CSN	ON	23.523.413,41	0,35%
EMBRATEL PART	ON	70.422,75	0,00%
EMBRATEL PART	PN	8.488,63	0,00%
ENERGIAS DO BRASIL	ON	11.044.268,57	0,16%
FRAS-LE	ON	10.170.000,00	0,15%
GAZETA MERCANTIL	PN	77.611,67	0,00%
GERDAU	PN	45.511.065,00	0,67%
GRENDENE	ON	12.023.640,00	0,18%
GTD	ON	1.313.678,75	0,02%
GTD	PN	1.179.443,55	0,02%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA VARIÁVEL			
Mercado à Vista			
Empresas		Valor de Mercado	% s/Segmento
INEPAR *	ON	0,00	0,00%
INEPAR ENERGIA	ON	1.208.288,09	0,02%
INEPAR ENERGIA	PNA	2.482.920,21	0,04%
INVITEL	ON	24.597.478,40	0,36%
ITAUBANCO	PN	243.018.487,60	3,56%
ITAUSA	PN	173.686.596,54	2,55%
LITEL	ON	803,00	0,00%
LITEL	PNA	1.604,54	0,00%
LOJAS AMERICANAS	ON	6.149.401,00	0,09%
LOJAS AMERICANAS	PN	62.651.018,00	0,92%
METALÚRGICA GERDAU	PN	78.162.551,00	1,15%
NEWTEL	ON	23.291.362,80	0,34%
PARANAPANEMA	ON	18.160.329,60	0,27%
PERDIGAO	ON	145.934.990,80	2,14%
PERDIGAO	PN	223.441.601,83	3,28%
PETROBRAS	ON	313.999.669,00	4,61%
PETROBRAS	PN	656.785.220,80	9,63%
PETROBRAS IPIRANGA	PN	25.713.128,00	0,38%
PQ. HOPI HARI *	ON	0,00	0,00%
PQ. HOPI HARI *	PN	0,00	0,00%
RIPASA	PN	86.169.030,36	1,26%
SABESP	ON	20.024.365,53	0,29%
SADIA	PN	58.641.239,77	0,86%
SID. TUBARAO	PN	3.597.361,79	0,05%
SOUZA CRUZ	ON	8.231.444,00	0,12%
TEL. DATA BRASIL	ON	385,10	0,00%
TEL. DATA BRASIL	PN	125.670,08	0,00%
TELE CENTRO OESTE	ON	5.465,46	0,00%
TELE CENTRO OESTE	PN	11.389,56	0,00%
TELE LESTE CELULAR	ON	221,60	0,00%
TELE LESTE CELULAR	PN	469,12	0,00%
TELE NORTE CELULAR	ON	655,49	0,00%
TELE NORTE CELULAR	PN	524,39	0,00%
TELE NORTE LESTE	ON	89.253.972,35	1,31%
TELE NORTE LESTE	PN	93.604.777,49	1,37%
TELE SUDESTE CELULAR	ON	2.761,22	0,00%
TELE SUDESTE CELULAR	PN	5.722,50	0,00%
TELEBRAS	ON	57,36	0,00%
TELEBRAS	PN	15.994,37	0,00%
TELEBRAS RECIBO	PN	6.805.570,02	0,10%
TELEMAR NL	PNA	53.663.498,26	0,79%
TELEMIG CEL PART	ON	9.911.125,63	0,15%
TELEMIG CEL PART	PN	2.029.167,75	0,03%
TELESP	ON	27.043,38	0,00%
TELESP	PN	30.717.788,76	0,45%
TELESP CEL PART	ON	2.488,47	0,00%

CONTINUA

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA VARIÁVEL			
Mercado à Vista			
Empresas		Valor de Mercado	% s/Segmento
TELESP CEL PART	PN	5.764,00	0,00%
TIM PARTICIPAÇÕES	ON	8.159,18	0,00%
TIM PARTICIPAÇÕES	PN	4.252.060,46	0,06%
TRACTEBEL ENERGIA	ON	15.033.741,50	0,22%
TRAN PAULISTA	PN	41.021.942,37	0,60%
ULTRAPAR	PN	22.948.211,00	0,34%
UNIBANCO	UNT	54.841.210,00	0,80%
VALE	PNA	567.963.606,00	8,33%
VALE	ON	229.446.926,00	3,37%
VOTORANTIM C. PAPEL	PN	30.150.756,90	0,44%
WEG	PN	18.774.351,00	0,28%
TOTAL		4.707.833.861,60	69,05%

FINANCIAMENTO DE PROJETOS		
Projetos	Valor de Mercado	% s/Segmento
Marlim	14.848.655,40	0,22%
Novamarlim	57.489.654,18	0,84%
Estacionamento Cinelândia	5.714.030,00	0,08%
Termobahia	65.410.974,17	0,96%
Albacora	271.084.463,23	3,98%
Clep	31.905.000,00	0,47%
TOTAL	446.452.776,98	6,55%

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL		
Fundos de Renda Variável	Valor de Mercado	% s/Segmento
Carteira Ativa II	845.788.566,88	12,41%
Energia São Paulo	279.773.849,21	4,10%
Brasil Private Equity	90.201.327,19	1,32%
Fiago Participações S.A.	36.237.157,33	0,53%
FIP Governância e Gestão	1.689.216,43	0,02%
Pactual Internet	7.781.506,22	0,11%
Fundo Brascan de Petróleo, Gás e Energia	1.574.578,84	0,02%
IP Seleção Exclusivo	116.201.395,26	1,70%
Lúmina FIA	153.141.273,93	2,25%
Fator Sinergia	48.090.835,57	0,71%
Brasil Energia	9.597.419,65	0,14%
Excelencia Social	5.301.657,15	0,08%
Dynamo Puma II	19.697.750,01	0,29%
TOTAL	1.615.076.533,67	23,69%
VALORES A PAGAR/RECEBER		
Valores a Pagar	(21.438.833,80)	-0,31%
Valores a Receber	70.169.074,18	1,03%
TOTAL	48.730.240,38	
TOTAL SEGMENTO RENDA VARIÁVEL	6.818.093.412,63	100,00%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA FIXA

Títulos Públicos		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
NTN	12.928.545.713,35	69,85%
CFT	13.411.974,39	0,07%
TDAE	5.992.336,83	0,03%
TOTAL	12.947.950.024,57	69,96%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA FIXA

Títulos Privados		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
Debêntures não Conversíveis	290.381.150,45	1,57%
Cia Energética Minas Gerais - CEMIG	83.730.337,19	
Cia Saneamento Básico Estado São Paulo - SABESP	8.402.235,89	
Cia Vale do Rio Doce	135.132,61	
Concessionária Rodovia Osório Porto Alegre - CONCEPA	8.140.988,22	
Copel	49.343.135,02	
CPFL Geração Energia	23.058.833,86	
Gulfshopping	46.597.289,39	
La Fonte	32.854.618,58	
Natal Shopping Center	38.118.579,69	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública	86.506.975,01	0,47%
Paranapanema	86.506.975,01	
Letra Hipotecária	24.140.820,81	0,13%
Caixa Economica Federal	24.140.820,81	
Certificado de Recebíveis Imobiliários	70.573.737,70	0,38%
Hospital da Bahia	32.133.532,66	
C-Mac Brasil	1.763.337,51	
Cometa	20.275.302,65	
Boa Viagem Medical	10.781.163,08	
Facamp	5.620.401,80	
Fundo de Investimento em Direitos Creditórios	183.146.655,89	0,99%
GP AETATIS II	5.019.660,71	
RB Fiducia High Income	10.373.503,23	
BMG - Servidores Públicos I	43.631.773,52	
BMG - Servidores Públicos II	38.466.214,08	
BANCOOP I	7.784.484,93	
ASM FCVS	77.871.019,42	
TOTAL	654.749.339,86	2,55%

FUNDOS DE RENDA FIXA

Fundo	Valor de Mercado	% s/Segmento
FIC de FIM Madson	70.035,57	0,00%
FIC de FIM Petros Crédito	1.088.581.603,49	5,88%
FIC de FIM Petros Moderado	2.475.285.495,24	13,37%
FIC de FIM Renda Fixa Liquidez	919.155.605,41	4,97%
FIC de FIM Multicarteira	422.626.798,00	2,28%
TOTAL	4.905.719.537,71	26,52%

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	(245.486,08)	
TOTAL	(245.486,08)	
TOTAL SEGMENTO RENDA FIXA	18.508.173.416,06	99,02%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO IMÓVEIS		
Grupo	Valor de Mercado	% s/Segmento
Desenvolvimento	-	0,00%
Aluguéis e Renda	774.328.555,86	79,69%
Fundos Imobiliários	172.339.898,97	17,74%
Outros Investimentos	25.061.659,15	2,58%
Provisão para Perda	-	0,00%
TOTAL SEGMENTO IMÓVEIS	971.730.113,98	
VALORES A PAGAR/RECEBER		
Valores a Pagar	(2.026.568,90)	
Valores a Receber	-	
TOTAL	(2.026.568,90)	
TOTAL SEGMENTO IMÓVEIS	969.703.545,08	100,00%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS			
Empréstimos			
Indexador	Atrasados	Não Atrasados	
TR	0	1.048.904.047,90	
Provisão para perda		-	
Financiamentos			
Indexador	Atrasados	Não Atrasados	
-	0	0	
VALORES A PAGAR/RECEBER			
Valores a Pagar		(9.874.958,54)	
Valores a Receber		-	
TOTAL		(9.874.958,54)	
TOTAL SEGMENTO EMPRÉSTIMOS		1.039.029.089,36	

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS (MODELO COTAS)			
Segmento	Rentabilidade Trimestre	Benchmark	Rentabilidade Benchmark
Renda Fixa	2,68%	CDI	4,74%
Renda Variável	18,14%	IBX-50	27,95%
Imóveis	3,25%	IPCA+6%	2,25%
Empréstimos e Financiamentos	4,57%	IPCA+6%	2,25%

DEMONSTRATIVO DOS CUSTOS INCORRIDOS COM CADA UMA DAS ATIVIDADES				
Gestão	Consultoria de Investimentos	Custódia	Corretagens	Outros
848.023,17	37.009,45	40.734,45	423.334,21	152.998,24

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 Nº3121/03	
O enquadramento dos investimentos se dará conforme artigo 4º da resolução CMN nº 3121/03	