

• ENCARTE DA REVISTA
PETROS – FUNDAÇÃO
PETROBRAS DE
SEGURIDADE SOCIAL
• EDIÇÃO EXTRA
• DEZEMBRO DE 2007

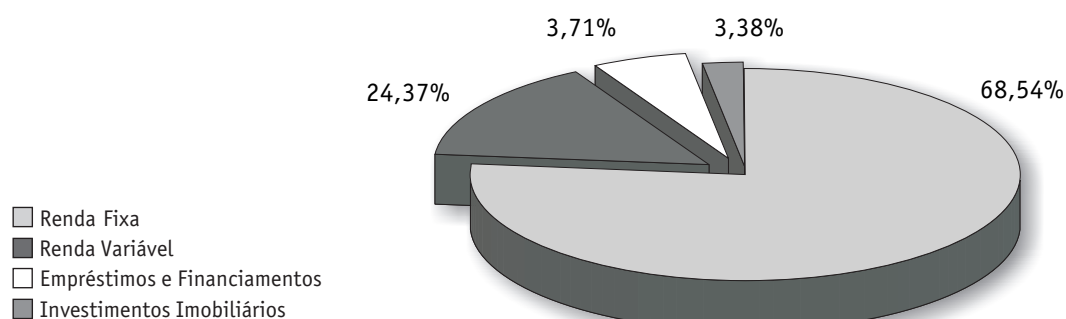


*DEMONSTRATIVO ANALÍTICO
DE INVESTIMENTOS E
ENQUADRAMENTO DAS
APLICAÇÕES – DAIEA*

3º TRIMESTRE DE 2006

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO				
Segmento	3º Trimestre de 2005		3º Trimestre de 2006	
	Valor	Percentual	Valor	Percentual
Renda Fixa	18.508.173.416,06	71,10%	20.967.527.005,71	68,54%
Renda Variável	6.818.093.412,63	21,33%	7.455.792.387,27	24,37%
Investimentos Imobiliários	969.703.545,08	3,76%	1.034.256.268,03	3,38%
Empréstimos e Financiamentos	899.951.554,58	3,66%	1.059.497.165,49	3,70%
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	27.334.999.463,13	100,00%	30.592.313.780,39	100,00%

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO - 3º TRIMESTRE DE 2006



DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR PLANO		
Plano de Benefício	Valor	Percentual
Plano BD		
- Renda Fixa	20.886.321.973,08	68,27%
- Renda Variável	7.455.792.387,27	24,37%
- Investimentos Imobiliários	1.034.256.268,03	3,38%
- Empréstimos e Financiamentos	1.134.738.119,38	3,71%
Plano CD		
- Renda Fixa	81.205.032,63	0,27%
- Renda Variável	0	
- Investimentos Imobiliários	0	
- Empréstimos e Financiamentos	0	

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS – GESTÃO TERCEIRIZADA		
Gestor	Valor	Percentual
Banco Itaú S.A.	539.978.929,01	6,17%
Mellon Serv. Financeiro LTDA	1.633.145.926,49	18,67%
Banco Brascan S.A.	1.773.480,21	0,02%
Investidor Profissional S.A	159.557.548,40	1,82%
Governança e Gestão	7.740.526,22	0,09%
Banco Pactual S.A.	176.907.953,77	2,02%
Dynamo S.A	266.708.206,66	3,05%
BB DTVM	295.486.426,65	3,38%
Banco Fator S.A	10.927.168,25	0,12%
Banco BBM S.A.	368.984.176,31	4,22%
Banco ABN Anro Real S.A.	1.754.336,31	0,02%

CONTINUA

CONTINUAÇÃO

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS – GESTÃO TERCEIRIZADA		
Gestor	Valor	Percentual
GP Administração de Recursos S.A	4.843.396,32	0,06%
BankBoston Asset Management LTDA	262.853.219,84	3,00%
Bradesco Asset Management LTDA - BRAM	3.304.517.548,19	37,77%
HSBC Bank Brasil S.A.	463.217.926,76	5,29%
Banco Safra S.A.	230.476.988,42	2,63%
Banco Santander Brasil S.A.	358.539.173,24	4,10%
Votorantim asset Management DTVM LTDA	192.677.840,35	2,20%
Hedging Griffio Asset Management S.A.	154.805.748,08	1,77%
Banco BNP Paribas Brasil	155.446.914,73	1,78%
Gap Gestora de Recursos LTDA	157.024.659,26	1,79%
CRP Cia de Participações	495.337,68	0,01%
Rio Bravo Investimentos S.A.	1.209.104,84	0,01%
TOTAL	8.749.072.535,99	100,00%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA VARIÁVEL			
Mercado à Vista			
Empresas		Valor de Mercado	% s/Segmento
AES TIETE	PN	28.558.647,84	0,38%
ALL AMERICA LATINA	UNT	7.621.250,00	0,10%
ALPARGATAS	PN	32.643.230,00	0,44%
AMBEV	PN	142.138.025,10	1,91%
ARACRUZ	PNB	13.039.530,00	0,17%
ARCELOR BR	ON	39.635.112,00	0,53%
BANCO DO BRASIL	ON	47.711.746,00	0,64%
BRADESCO	PN	393.019.948,16	5,27%
BRADESPAR	PN	33.391.536,00	0,45%
BRASIL TELECOM PART	ON	38.808.527,60	0,52%
BRASIL TELECOM PART	PN	26.028.096,40	0,35%
BRASIL TELECOM	PN	3.166.810,04	0,04%
BRASKEM	ON	33.215.251,75	0,45%
BRASKEM	PNA	27,30	0,00%
CEMIG	PN	178.696.013,00	2,40%
COELCE	PNA	62.370.763,16	0,84%
CONFAB	PN	44.411.098,54	0,60%
COPEL	PNB	58.801.851,00	0,79%
COPEL	ON	18.483.525,00	0,25%
COTEMINAS	ON	22.144.540,00	0,30%
COTEMINAS	PN	11.198.284,41	0,15%
CSN	ON	25.070.073,00	0,34%
ELETRON	ON	9.715.146,00	0,13%
ELETRON	PNB	10.213.152,00	0,14%
ENERGIAS DO BRASIL	ON	13.671.284,80	0,18%
FRAS-LE	ON	12.091.000,00	0,16%
GAZETA MERCANTIL	PN	77.611,67	0,00%
GERDAU	PN	57.387.577,50	0,77%
GRENESE	ON	7.764.518,00	0,10%

CONTINUA

CONTINUAÇÃO

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA VARIÁVEL			
Mercado à Vista			
Empresas		Valor de Mercado	% s/Segmento
GTD	ON	20.590.576,00	0,28%
GTD	PN	522.707,94	0,01%
IDEIASNET	ON	10.141.744,62	0,14%
INEPAR	ON	1.422,22	0,00%
INEPAR ENERGIA	ON	3.815.646,60	0,05%
INEPAR ENERGIA	PNA	7.594.814,76	0,10%
INVITEL	ON	24.597.478,40	0,33%
ITAUBANCO	PN	299.024.964,00	4,01%
ITAUSA	PN	242.092.234,20	3,25%
LITEL	ON	803,00	0,00%
LITEL	PNA	1.604,54	0,00%
LOJAS AMERICANAS	ON	8.948.214,00	0,12%
LOJAS AMERICANAS	PN	31.255.237,89	0,42%
METALÚRGICA GERDAU	PN	94.553.019,19	1,27%
NATURA	ON	4.610.235,00	0,06%
NET SERVIÇOS	PN	25.310.448,00	0,34%
NEWTEL	ON	22.749.703,20	0,31%
PÃO DE AÇUCAR	PN	6.818.112,00	0,09%
PARANAPANEMA	ON	30.123.086,40	0,40%
PERDIGAO	ON	350.108.085,75	4,70%
PETROBRAS	ON	524.433.649,20	7,03%
PETROBRAS	PN	724.378.099,20	9,72%
PQ. HOPI HARI *	ON	0,00	0,00%
PQ. HOPI HARI *	PN	0,00	0,00%
SUZANO PAPEL E CELULOSE	PNA	52.649.218,56	0,71%
TELE NORTE LESTE	ON	74.661.756,64	1,00%
TELEBRAS	PN	13.611,14	0,00%
TELEBRAS RECIBO	PN	6.354.133,88	0,09%
TELEMAR NL	PNA	7.310.645,00	0,10%
TELEMIG CEL PART	ON	7.747.635,02	0,10%
TELEMIG CEL PART	PN	2.123.523,62	0,03%
TELESP	PN	34.093.093,59	0,46%
TRACTEBEL ENERGIA	ON	54.672.504,90	0,73%
TRAN PAULISTA	PN	12.957.459,80	0,17%
UNIBANCO	UNT	37.342.980,00	0,50%
USIMINAS	PNA	28.586.151,00	0,38%
VALE	PNA	438.238.374,20	5,88%
VALE	ON	311.367.987,00	4,18%
VOTORANTIM C. PAPEL	PN	63.297.133,68	0,85%
TOTAL		4.934.162.270,41	65,33%

CONTINUA

FINANCIAMENTO DE PROJETOS		
Projetos	Valor de Mercado	% s/Segmento
Marlim	10.229.073,72	0,14%
Novamarlim	43.561.289,00	0,58%
Estacionamento Cinelândia	5.714.030,00	0,08%
Termobahia	65.756.397,33	0,88%
Albacora	228.395.317,39	3,06%
Clep	28.179.000,00	0,38%
TOTAL	381.835.107,44	5,12%

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL		
Fundos de Renda Variável	Valor de Mercado	% s/Segmento
Carteira Ativa II	1.246.447.393,55	16,72%
Energia São Paulo	351.428.294,64	4,71%
Fiago Participações S.A.	35.270.238,30	0,47%
FIP Governancia e Gestão	7.740.526,22	0,10%
Infra Brasil	1.754.336,31	0,02%
Logística Brasil	4.843.396,32	0,06%
Fundo Brascan de Petroleo, Gas e Energia	1.773.480,21	0,02%
IP Seleção FIA	159.557.548,40	2,14%
Lúmina FIA	206.128.014,90	2,76%
Fator Sinergia	10.927.168,25	0,15%
Brasil Energia	20.454.648,67	0,27%
Excelencia Social	12.527.783,22	0,17%
Dynamo Puma II	60.580.191,76	0,81%
CRP VI Venture	495.337,68	0,01%
Investech II	1.209.104,84	0,02%
TOTAL	2.121.137.463,27	28,45%
VALORES A PAGAR/RECEBER		
Valores a Pagar	(18.796.874,31)	-0,25%
Valores a Receber	37.454.420,46	
TOTAL	18.657.546,15	
TOTAL SEGMENTO RENDA VARIÁVEL	7.455.792.387,27	99,15%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA FIXA		
Títulos Públicos		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
NTN	13.751.315.628,05	65,58%
CFT	13.854.988,40	0,07%
TDAE	5.140.224,86	0,02%
TOTAL	13.770.310.841,31	65,67%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO RENDA FIXA		
Títulos Privados		
Espécie	Valor de Mercado	% s/Segmento
Debêntures não Conversíveis	245.063.735,96	1,17%
Cia Energética Minas Gerais - CEMIG	43.211.502,72	
Cia Saneamento Básico Estado São Paulo - SABESP	1.676.025,79	
Cia Vale do Rio Doce	139.528,06	
Concessionária Rodovia Osório Porto Alegre - CONCEPA	5.600.586,16	
Copel	50.895.908,94	
CSN	71.642.336,51	
CPFL Geração Energia	23.788.393,74	
Gulfshopping	48.109.454,04	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública	94.719.229,90	0,45%
Paranapanema	94.719.229,90	
Letra Hipotecária	8.301.118,23	0,04%
Caixa Economica Federal	8.301.118,23	
Certificado de Recebíveis Imobiliários	71.544.921,93	0,34%
Hospital da Bahia	33.878.229,65	
Cometa	19.315.718,32	
Boa Viagem Medical	11.802.553,95	
Facamp	6.548.420,01	
Fundo de Investimento em Direitos Creditórios	149.345.039,74	0,71%
GP AETATIS II	5.768.354,05	
RB Fiducia High Income	9.393.618,46	
BMG - Servidores Públicos II	23.983.268,68	
BMG - Servidores Públicos III	9.750.680,07	
BANCOOP I	7.879.625,03	
ASM FCVS	92.569.493,45	
TOTAL	568.974.045,76	2,71%

FUNDOS DE RENDA FIXA		
Fundo	Valor de Mercado	% s/Segmento
FIC de FIM Petros Crédito	985.811.093,23	4,70%
FIC de FIM Petros Moderado	2.861.719.718,64	13,65%
Fundo Inv Renda Fixa Liquidez	2.156.678.154,86	10,29%
FIC de FIM Multicarteira	623.726.105,99	2,97%
TOTAL	6.627.935.072,72	31,61%

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	307.045,92	0,00%
TOTAL	307.045,92	
TOTAL SEGMENTO RENDA FIXA	20.967.527.005,71	100,00%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO IMÓVEIS		
Grupo	Valor de Mercado	% s/Segmento
Desenvolvimento	19.740.895,00	1,90%
Aluguéis e Renda	817.425.434,51	78,72%
Fundos Imobiliários	201.186.555,67	19,38%
Outros Investimentos	-	0,00%
Provisão para Perda	-	0,00%
TOTAL SEGMENTO IMÓVEIS	1.038.352.885,18	
VALORES A PAGAR/RECEBER		
Valores a Pagar/Receber	(4.096.617,15)	
Valores a Receber	-	
TOTAL	(4.096.617,15)	
TOTAL SEGMENTO IMÓVEIS	1.034.256.268,03	100,00%

COMPOSIÇÃO DO SEGMENTO EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS			
Empréstimos			
Indexador	Atrasados	Não Atrasados	
TR	0	1.150.118.623,09	
CDI	0	570.488,35	
Provisão para perda		906.786,42	
Financiamentos			
Indexador	Atrasados	Não Atrasados	
-	0	0	
VALORES A PAGAR/RECEBER			
Valores a Pagar		(14.473.717,29)	
Valores a Receber		-	
TOTAL		(14.473.717,29)	
TOTAL SEGMENTO EMPRÉSTIMOS		1.134.738.119,38	

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS (MODELO COTAS)			
Segmento	Rentabilidade Semestre	Benchmarks	Benchmarks Ponderados
Renda Fixa	2,61%	CDI, NTNB+1% e Meta Atuarial	2,39%
Renda Variável	-0,43%	IBX-50, NTNB+1,5% e NTNB+5%	0,10%
Imóveis	7,03%	NTNB	2,87%
Empréstimos e Financiamentos	4,41%	META ATUARIAL	1,64%

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. 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	