DI - DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS PLANO DE BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS BDMG - 2º SEMESTRE DE 2012

INFORMAÇÕES SOBRE A ENTIDADE

Nome da Entidade:	DESBAN Fundação BDMG de Seguridade Social	**Sigla da Entidade:**	DESBAN
Estado da Entidade:	MG	**Nome do Plano:**	Plano BDMG BD
Tipo do Plano:	BD	**Telefone** (31) 3249-8504	**E-mail**: financeiro@desban.org.br
Administrador Responsável :	Iris Lanna de Moraes	**CPF:**	489.370.296-34
Auditoria de Gestão:	Teixeira & Associados Auditores Independentes	**CNPJ do Auditor de Gestão:**	38.726.261/0001-66

COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS

		%	Valores em reais	31/12/2012	
PROGRAMA DE INVESTIMENTOS	**812.397.288,89**	**100,00%**	FIC FIDC Caixa UBS Pactual II	381.605,96	0,05%
			FIDC BMG VIII	12.130.414,06	1,49%
SEGMENTO DE RENDA FIXA	**601.644.922,95**	74,06%	**SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL**	**143.661.167,74**	**17,68%**
TÍTULOS PÚBLICOS	**474.429.801,12**	58,40%	**FUNDO DE INVESTIMENTO- AÇÕES**	**143.661.167,74**	17,68%
Ntn-b	423.102.785,14	52,08%	BNY Mellon ARX FIA	41.079.315,70	5,06%
Ntn-f	51.327.015,98	6,32%	XP Investor FIA	27.926.953,62	3,44%
TÍTULOS PRIVADOS	**104.476.612,67**	12,86%	Itau RPI Ações IBOVESPA	29.085.875,44	3,58%
CDB's	**62.064.578,94**	7,64%	Btg Dividendos FIA	24.235.076,61	2,98%
Banco Votorantim S/A	23.751.453,77	2,92%	Sulamerica Expertise FIA	21.333.946,37	2,63%
Banco Daycoval S/A	20.643.180,52	2,54%	**SEGMENTO DE INV. ESTRUTURADOS**	**19.282.287,14**	**2,37%**
Banco Pine S/A	17.669.944,65	2,18%	Lacan Florestal Part.	491.990,41	0,06%
DEBÊNTURES	**21.368.946,35**	2,63%	FIQ FIA Participações	2.324.276,03	0,29%
BR Malls	1.014.195,86	0,12%	Agencias Caixa FII	11.369.900,00	1,40%
Cemig	5.482.591,36	0,67%	FII Brazilian Cap	5.096.120,70	0,63%
MGI	10.000.000,00	1,23%	**SEG. OPERAÇÃO COM PARTIPANTE**	**11.109.134,49**	**1,37%**
Sabesp	1.010.015,84	0,12%	**EMPRÉSTIMOS**	**11.057.806,04**	1,36%
Telemar	879.879,45	0,11%	Simples	11.057.806,04	1,36%
Vale	2.034.213,22	0,25%	**FINANCIAMENTOS HABITAC.**	51.328,45	0,01%
Vale	948.050,62	0,12%	**SEGMENTO DE IMÓVEIS**	**36.699.776,57**	**4,52%**
DPGE	**21.043.087,38**	2,59%	**LOCADOS A TERCEIROS**	**36.699.776,57**	4,52%
BicBanco	13.213.192,38	1,63%	Life Center Parking	22.077.903,69	2,72%
Banco BMG	7.829.895,00	0,96%	Life Center Sistema de Saúde	14.476.184,76	1,78%
FUNDOS DE INVESTIMENTOS	**22.738.509,16**	2,80%	Aluguéis a Receber	145.688,12	0,02%
FIDC'S	**22.738.509,16**	2,80%			0,00%
FIDC CEDAE 2º Serie - Senior	8.913.438,28	1,10%			
FIDC CPMG	1.313.050,86	0,16%			

RENTABILIDADE DA DESBAN X BENCHMARK X MÍNIMO ATUARIAL - 2º SEMESTRE 2012

SEGMENTO	Rentabilidade %	%	BENCHMARK	MINIMO ATUARIAL
Renda Fixa	36,03%	11,34%	Meta Atuarial (IPCA + 5,50% a.a.)	5,50%
Renda Variavel	18,04%	7,94%	Ibovespa	
Oper. C/ participantes	17,29%	14,65%	Meta Atuarial (IPCA + 5,50% a.a.) + 3,00% a.a.	
Imóveis	5,12%	11,34%	Meta Atuarial (IPCA + 5,50% a.a.)	
Investimentos Estruturados	-66,87%	12,44%	Meta Atuarial (IPCA + 5,50% a.a.) + 1,00% a.a.	
Investimentos Totais	29,59%	11,34%	Meta Atuarial (IPCA + 5,50% a.a.)	

ALOCAÇÃO DE RECURSOS

2º SEMESTRE DE 2011			2º SEMESTRE DE 2012		
SEGMENTO	**R$**	**%**	**SEGMENTO**	**R$**	**%**
Investimentos Totais	664.204.912,86	100,00%	Investimentos Totais	812.397.288,89	100,00%
Renda Fixa	517.484.142,86	77,91%	Renda Fixa	601.644.922,95	74,06%
Renda Variável	97.019.861,60	14,61%	Renda Variável	143.661.167,74	17,68%
Investimentos Imobiliários	37.684.770,19	5,67%	Investimentos Imobiliários	36.699.776,57	4,52%
Operações com Participantes	10.878.623,80	1,64%	Operações com Participantes	11.109.134,49	1,37%
Investimentos Estruturados	1.137.514,41	0,17%	Investimentos Estruturados	19.282.287,14	2,37%

CLASSIFICAÇÃO DE RISCO DE CRÉDITO

ATIVOS	RATING	AGÊNCIA	ATIVOS	RATING	AGÊNCIA
CDB's			**DPGE'S**		
Banco Votorantim S/A	AA+	Fitch	Banco Bicbanco S/A	A+	Fitch
Banco Daycoval S/A	AA-	Fitch	Banco BMG S/A	BB+	S&P
Banco Pine S/A	A+	Fitch			
DEBÊNTURES			**FIDC'S**		
BR Malls	AA	Moody's	FIDC CEDAE 2º Serie - Senior	AA	Fitch
Cemig	A+	Fitch	FIDC CPMG	AA-	Fitch
MGI	AA	Moody's	FIC FIDC Caixa UBS Pactual II	AA	SR
Sabesp	AA-	S&P	FIDC BMG VIII	AAA	S&P
Telemar	AA-	Moody's			

DI - DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS PLANO DE BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS BDMG - 2º SEMESTRE DE 2012					
Vale	AA+	Fitch			
Vale	AA+	Fitch			

DIVERGÊNCIA NÃO PLANEJADA - DNP			
Segmento	**DNP Mensal**	**Acum. 12 meses**	**DNP Acum. 36 meses**
Investimentos Totais	13,5972%	16,2305%	15,1699%
Renda Fixa	18,8093%	21,8027%	26,8535%
Renda Variável	3,3190%	6,5907%	-24,3280%
Imóveis	-2,5536%	-5,7693%	71,6398%
Empréstimos e Financiamentos	0,4059%	5,2697%	15,0731%
Investimentos Estruturados	-8,4113%	-18,3412%	-124,7407%

DI - DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS PLANO DE BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS BDMG CV - 2º SEMESTRE DE 2012

INFORMAÇÕES SOBRE A ENTIDADE

Nome da Entidade:	DESBAN Fundação BDMG de Seguridade Social	**Sigla da Entidade:**		DESBAN
Estado da Entidade:	MG	**Nome do Plano:**		Plano BDMG CV
Tipo do Plano:	CV	**Telefone**	(31) 3249-8504	**E-mail**: financeiro@desban.org.br
Administrador Responsável :	Iris Lanna de Moraes	**CPF:**		489.370.296-34
Auditoria de Gestão:	Teixeira & Associados Auditores Independentes	**CNPJ do Auditor de Gestão:**		38.726.261/0001-66

COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS			Valores em reais	31/12/2012	
PROGRAMA DE INVESTIMENTOS	**759.501,90**	**%**	**FUNDOS DE INVESTIMENTOS**	**88.681,58**	11,68%
		100,00%	Itaú Soberano DI	88.681,58	11,68%
SEGMENTO DE RENDA FIXA	**759.501,90**	100,00%	**DEBÊNTURES**	**61.310,44**	**8,07%**
TÍTULOS PÚBLICOS	**321.456,74**	42,32%	BR Malls	20.697,87	2,73%
LFT	321.456,74	42,32%	MGI	20.000,00	2,63%
TÍTULOS PRIVADOS	**281.144,18**	37,02%	Sabesp	20.612,57	2,71%
CDB's	**219.833,74**	28,94%	**SEGMENTO DE INV. ESTRUTURADOS**	**68.219,40**	**8,98%**
Banco ABC S/A	28.151,90	3,71%	Agencias Caixa FII	68.219,40	8,98%
Banco BTG Pactual S/A	48.506,39	6,39%			
Banco Daycoval S/A	20.118,74	2,65%			
Banco Safra S/A	53.849,46	7,09%			
Banco Votorantim S/A	69.207,25	9,11%			

RENTABILIDADE DA DESBAN X BENCHMARK - 2º SEMESTRE 2012

SEGMENTO	Rentabilidade %	%	BENCHMARK
Renda Fixa	8,72%	8,49%	Selic
Investimentos Estruturados	13,70%	2,26%	IPCA + 6,5%
Investimentos Totais	9,85%	8,49%	Selic

ALOCAÇÃO DE RECURSOS

2º SEMESTRE DE 2011			2º SEMESTRE DE 2012		
SEGMENTO	**R$**	**%**	**SEGMENTO**	**R$**	**%**
Investimentos Totais	523.112,30	100,00%	Investimentos Totais	759.501,90	100,00%
Renda Fixa	523.112,30	100,00%	Renda Fixa	691.282,50	91,02%
		0,00%	Investimentos Estruturados	68.219,40	8,98%

CLASSIFICAÇÃO DE RISCO DE CRÉDITO

ATIVOS	RATING	AGÊNCIA	ATIVOS	RATING	AGÊNCIA
CDB's			**DEBÊNTURES**		
Banco ABC S/A	AA-	Fitch	BR Malls	AA	Moody's
Banco BTG Pactual S/A	AA	Fitch	MGI	AA	Moody's
Banco Daycoval S/A	AA-	Fitch	Sabesp	AA-	S&P
Banco Safra S/A	AA+	Fitch			
Banco Votorantim S/A	AA+	Fitch			

DIVERGÊNCIA NÃO PLANEJADA - DNP

Segmento	DNP Mensal	Acum. 12 meses	DNP Acum. 36 meses
Investimentos Totais	0,2137%	1,2532%	1,2653%
Renda Fixa	0,0177%	0,2143%	0,2264%
Investimentos Estruturados	2,2439%	12,3051%	12,3051%

DI - DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS PROGRAMA DE GESTÃO ADMINISTRATIVA - PGA - 2º SEMESTRE DE 2012

INFORMAÇÕES SOBRE A ENTIDADE

Nome da Entidade:	DESBAN Fundação BDMG de Seguridade Social	**Sigla da Entidade:**	DESBAN
Estado da Entidade:	MG	**Nome do Plano:**	Plano de Gestão Administrativa
Tipo do Plano:	PGA	**Telefone** (31) 3249-8504	**E-mail**: financeiro@desban.org.br
Administrador Responsável :	Iris Lanna de Moraes	**CPF:**	489.370.296-34
Auditoria de Gestão:	Teixeira & Associados Auditores Independentes	**CNPJ do Auditor de Gestão:**	38.726.261/0001-66

COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS

			Valores em reais	31/12/2012	
PROGRAMA DE INVESTIMENTOS	**5.665.382,09**	**%**	**TÍTULOS PÚBLICOS**	**1.524.082,47**	**26,90%**
		100,00%	LFT	136.210,48	2,40%
SEGMENTO DE RENDA FIXA	**4.664.658,66**	**82,34%**	NTN-B	1.223.733,06	21,60%
TÍTULOS PRIVADOS	**1.747.328,33**	**30,84%**	NTN-F	164.138,93	2,90%
CDB's	**1.747.328,33**	**30,84%**	**FUNDOS DE INVESTIMENTOS**	**1.243.247,86**	**21,94%**
Banco ABC Brasil S/A	426.092,08	7,52%	Itaú Soberano	1.243.247,86	21,94%
Banco Daycoval S/A	423.420,51	7,47%	**SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL**	**1.000.723,43**	**17,66%**
Banco Pine	382.952,05	6,76%	**FUNDO DE INVESTIMENTO- AÇÕES**	**1.000.723,43**	**17,66%**
Banco Votorantim S.A.	514.863,69	9,09%	BNY Mellon ARX FIA	422.961,62	7,47%
DEBÊNTURES	**150.000,00**	**2,65%**	Itau RPI Ações IBOVESPA	425.793,04	7,52%
MGI	150.000,00	2,65%	UBS Pactual Institucional Dividendos FIA	151.968,77	2,68%

RENTABILIDADE DA DESBAN X BENCHMARK - 2º SEMESTRE 2012

SEGMENTO	Rentabilidade %	%	BENCHMARK
Renda Fixa	11,55%	8,49%	Selic
Renda Variável	17,51%	7,40%	Ibovespa
Investimentos Totais	12,48%	8,64%	85% (Selic) + 15% (IBOV)

ALOCAÇÃO DE RECURSOS

2º SEMESTRE DE 2011			2º SEMESTRE DE 2012		
SEGMENTO	**R$**	**%**	**SEGMENTO**	**R$**	**%**
Investimentos Totais	5.483.925,72	100,00%	Investimentos Totais	5.665.382,09	100,00%
Renda Fixa	4.764.318,41	86,88%	Renda Fixa	4.664.658,66	82,34%
Renda Variável	719.607,31	13,12%	Renda Variável	1.000.723,43	17,66%

CLASSIFICAÇÃO DE RISCO DE CRÉDITO

ATIVOS	RATING	AGÊNCIA	ATIVOS	RATING	AGÊNCIA
CDB's			**DEBÊNTURES**		
Banco ABC Brasil S/A	AA-	Fitch	MGI	AA	Moody's
Banco Daycoval S/A	AA-	Fitch			
Banco Pine	A+	Fitch			
Banco Votorantim S.A.	AA+	Fitch			

DIVERGÊNCIA NÃO PLANEJADA - DNP

Segmento	DNP Mensal	Acum. 12 meses	DNP Acum. 36 meses
Investimentos Totais	-0,0080%	3,3960%	1,0328%
Renda Fixa	-0,5617%	2,5335%	4,2930%
Renda Variável	2,8641%	8,5916%	-16,0934%