

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - BNB FI Renda Fixa Plus LP
POSIÇÃO: 30/04/2012

ATIVO	VALOR	(%)
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS	123.788.283,42	29,89
Lastreadas com títulos públicos federais		
Vencimento 02/05/2012	103.910.789,20	25,09
Vencimento 31/05/2012	19.877.494,22	4,80
TÍTULOS PRIVADOS	118.864.611,19	28,71
Certificados de Depósitos Bancários	<u>46.980.731,75</u>	11,35
CDB SAFRA	6.056.988,81	1,46
CDB SANTANDER	6.000.659,49	1,45
CDB ABC	5.857.197,46	1,41
CDB VOTORANTIM	5.800.181,96	1,40
CDB PINE	5.836.125,53	1,41
CDB DAYCOVAL	5.807.440,40	1,40
CDB BIC	5.809.370,73	1,40
CDB FIBRA	5.812.767,37	1,40
Depósitos a Prazo com Garantia Especial	<u>22.015.184,75</u>	5,32
DPGE BMB	5.826.828,99	1,41
DPGE INDUSVAL	4.846.185,24	1,17
DPGE BIC	5.413.466,11	1,31
DPGE BMG	5.928.704,41	1,43
Debêntures	<u>22.086.299,89</u>	5,33
DEB VALE	4.481.905,13	1,08
CEMIG GT - 1ª SÉRIE	3.195.021,36	0,77
BNDES Participações - 2ª SÉRIE	7.116.111,80	1,72
BNDES Participações - 3ª SÉRIE	7.293.261,60	1,76
Letras Financeiras Bancárias	<u>27.782.394,80</u>	6,71
LFB BRADESCO	4.845.627,61	1,17
LFB ITAU	4.466.063,60	1,08
LFB BANCO DO BRASIL	6.082.818,95	1,47
LFB CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.021.526,29	1,45
LFB CAIXA ECONÔMICA FEDERAL 2	6.366.358,35	1,54
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	171.428.038,81	41,39
Letras Financeiras do Tesouro Nacional	<u>163.815.777,05</u>	39,56
LFT 210100 07/09/2012	4.048.234,14	0,98
LFT 210100 07/03/2013	6.522.990,29	1,58
LFT 210100 07/09/2013	21.739.454,92	5,25
LFT 210100 07/03/2014	28.421.658,06	6,86
LFT 210100 07/09/2014	39.230.661,42	9,47
LFT 210100 07/03/2015	20.650.935,12	4,99
LFT 210100 07/09/2015	15.676.601,00	3,79
LFT 210100 07/09/2017	17.393.842,58	4,20
LFT 210100 01/03/2018	10.131.399,52	2,45
Letra do Tesouro Nacional	<u>3.408.326,19</u>	0,82
LTN 100000 01/04/2014	3.408.326,19	0,82
Notas do Tesouro Nacional	<u>4.203.935,57</u>	1,01
NTN-B 760199 15/08/2018	2.072.915,97	0,50
NTN-B 760199 15/08/2022	2.131.019,60	0,51
OUTROS	7.964,56	0,01
Total	414.088.897,98	100,00
PATRIMÔNIO LÍQUIDO 30/04/2012	412.726.167,39	