

<b>COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - BNB FI Multimercado LP</b>		
<b>POSIÇÃO:31/01/2012</b>		
<b>ATIVO</b>	<b>VALOR</b>	<b>(%)</b>
<b>OPERAÇÕES COMPROMISSADAS</b>	<b>380.182,82</b>	<b>10,64</b>
Lastreadas com títulos públicos federais		
Vencimento 08/03/2012	189.001,79	5,29
Vencimento 01/02/2012	191.181,03	5,35
<b>TÍTULOS PRIVADOS</b>	<b>867.599,44</b>	<b>24,29</b>
Certificados de Depósitos Bancários	<u>492.757,53</u>	13,80
CDB ABC	65.414,72	1,83
CDB VOTORANTIM	52.754,41	1,48
CDB BIC	63.292,40	1,77
CDB DAYCOVAL	63.251,38	1,77
CDB PINE	60.770,67	1,70
CDB SAFRA	63.219,80	1,77
CDB FIBRA	60.832,01	1,70
CDB SANTANDER	63.222,14	1,77
Depósitos a Prazo com Garantia Especial	<u>230.682,83</u>	6,46
DPGE BMG	64.357,94	1,80
DPGE BANIF	56.121,25	1,57
DPGE BMB	55.548,19	1,56
DPGE INDUSVAL	54.655,45	1,53
Debêntures	<u>144.159,08</u>	4,04
Vale CDI	50.896,61	1,42
BNDES Participações - 2º SÉRIE	17.031,00	0,48
BNDES Participações - 3º SÉRIE	76.231,47	2,13
<b>TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS</b>	<b>2.322.872,18</b>	<b>65,03</b>
Letras Financeiras do Tesouro Nacional	<u>2.158.244,50</u>	60,42
LFT 210100 07/09/2013	65.855,23	1,84
LFT 210100 07/03/2014	385.012,09	10,78
LFT 210100 07/09/2014	471.149,71	13,19
LFT 210100 07/03/2015	582.637,11	16,31
LFT 210100 07/09/2015	653.590,36	18,30
Letra do Tesouro Nacional	<u>54.121,30</u>	1,52
LTN 100000 01/04/2012	54.121,30	1,52
Notas do Tesouro Nacional - Série B	<u>110.506,38</u>	3,09
NTN-B 15/08/2016	38.256,73	1,07
NTN-B 15/08/2018	72.249,65	2,02
<b>OUTROS</b>	<b>1.305,36</b>	<b>0,04</b>
<b>Total</b>	<b>3.571.959,80</b>	<b>100,00</b>
<b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO EM 31/01/2012</b>	<b>3.565.927,92</b>	
Ambiente de Fundos de Investimento Célula de Gestão de Produtos e-mail: fundos@bnb.gov.br Telefone: (85) 3299.3544		