

Posição em 30 de setembro de 2007

Demonstrativo da Carteira de Investimentos	(R\$) saldo	%	Observações
Disponibilidades e Recuperação de créditos	1.529.404,85	0,16	
Renda Fixa	723.739.864,39	78,01	Limite por categoria de Ativo
Carteira Própria	723.739.864,39	78,01	Títulos TN, Créditos securitizados pelo TN, Títulos Estados e Municípios refinanciados TN
Carteira Terceirizada	0,00	0,00	FI/FIC aberto previdenciário RF ou Ref RF com títulos TN e títulos privados de baixo risco
Títulos de Responsabilidade do Governo Federal	114.400.361,85	12,33	FI/FIC Dívida Externa
Notas do Tesouro Nacional - NTN-A/NTN-B/NTN-C	105.616.820,09	11,38	
Letras do Tesouro Nacional	8.060.373,37	0,87	
Letras Financeiras do Tesouro	723.168,39	0,08	
Aplicações em Instituições Financeiras	100.549.443,09	10,84	
Certificados de Depósito Bancário	0,00	0,00	Títulos Estados e Municípios
Letras Hipotecárias	5.604.108,10	0,60	CDB, RDB, LCI, LCA e demais Títulos ou Coobrigações de Instituições Financeiras
Quotas de Fdos.de Inv.Fin.-R.Fix.	86.699.124,52	9,35	Poupança
Fdo.Apl.Quota Fdos.Inv.Financ.-R.Fix.	0,00	0,00	Debêntures, NP, Certificados Mercantis
Certificados de Recebíveis Imobiliários - CRI	8.246.210,47	0,89	Obrigações de Organismos Multinacionais
Títulos de Empresas	129.057.618,73	13,91	
Debêntures Conversíveis	11.992.992,00	1,29	FIDC / FICFIDC, CCB
Debêntures Não Conversíveis	117.064.626,73	12,62	CRIs e CCIs registrados na CVM
Outros Investimentos em Renda Fixa	379.732.440,72	40,93	
CCB	338.795.569,02	36,52	CPR-F com seguro, CDCA, CRA
CCI	4.249.704,63	0,46	
CFTE	12.477.777,01	1,34	
CRED	23.958.035,75	2,58	
SWAP	251.354,31	0,03	
A pagar/ A Receber	0,00	0,00	
Renda Variável	84.129.498,99	9,06	
Carteira Própria	84.129.498,99	9,06	Limite por categoria de Ativo
Carteira Terceirizada	0,00	0,00	Nível 2 ou Novo Mercado
Ações à vista	26.745.542,99	2,88	50%
Mercado de Opções	0,00	0,00	Nível 1
Fdo.Aplic.em Quotas Fdos Invest.Financ. - R.VAR.	59.197.841,04	6,38	45%
Bolsa de Mercadoria e de Futuro	0,00	0,00	Bovespa Mais
A Pagar/ A Receber	(1.813.885,04)	(0,20)	50%
Imóveis	69.057.551,01	7,45	Demais Clss Abertas e cotas de FI/FIC aberto previdenciários Ações
Carteira Própria	69.057.551,01	7,45	Participações (FIP, FIEE, ações, debêntures e valores mobiliários de SPE)
Carteira de fundos Imobiliário	0,00	0,00	20%
Carteira de aluguéis e renda	55.625.081,30	6,00	BDR, ações Mercusul, Debêntures c/ Part. Lucros, Ouro, CPAC, FI/FIC aberto
A Pagar/ A Receber	13.432.469,71	1,45	Multimercado
Empréstimo e/ou Financ.Imob. a Participantes	49.328.953,33	5,32	3%
Carteira Própria	49.328.953,33	5,32	
Recursos Garantidores	927.785.272,57	100,00	
Carteira Própria	927.785.272,57	100,00	
Carteira Terceirizada	0,00	0,00	

Enquadramento das aplicações

