

Posição em 30 de novembro de 2010

Demonstrativo da Carteira de Investimentos	Nov/2010	Out/2010	% Composição	% Variação	Limites de Alocação Geral	Limites de Alocação Emissor	Limites de Alocação Concentração			
Disponibilidades	5.546.602,95	7.845.127,03	0,41	(29,30)						
Investimentos	1.367.700.278,41	1.357.098.234,14	99,59	0,78						
Renda Fixa	862.253.553,37	836.136.702,34	62,78	3,12						
Títulos Públicos	209.486.350,28	223.276.561,60	15,25	(6,18)	100%	100%	100%			
Notas do Tesouro Nacional - NTN-A/NTN-B/NTN-C	193.514.636,33	207.519.042,59	14,09	(6,75)						
Créditos Securitizados do Tesouro - SNTC-CFTE	550.079,13	553.143,06	0,04	(0,55)						
Certificado Financeiro do Tesouro Estadual - STNC-CVS-CRED	15.421.634,82	15.204.375,95	1,12	1,43						
Contas a (Pagar) e a Receber	0,00	0,00	0,00	0,00						
Créditos Privados e Depósitos	504.730.852,43	497.688.794,63	36,75	1,41	80%	20%	20%			
Instituições Financeiras (DPGE/CDB e LH)	99.353.780,32	98.122.166,51	7,24	1,26						
Certificados de Depósito Bancário - CDB	43.406.663,96	42.967.003,75	3,16	1,02						
Depósito a Prazo com Garantia - DPGE	49.077.691,46	48.425.100,00	3,58	1,35						
Letras Hipotecárias - LH	6.869.424,90	6.730.062,76	0,50	2,07						
Classificação por Emissor										
Bco. BMG S/A	30.084.986,61	29.679.364,92	2,19	1,37						
CDB	13.880.627,71	13.691.042,70	1,01	1,38						
DPGE	16.204.358,90	15.988.322,22	1,18	1,35						
Bco. Pan Americano	30.852.964,81	30.456.818,85	2,25	1,30						
CDB	13.966.713,31	13.782.016,71	1,02	1,34						
DPGE	16.886.251,50	16.674.802,14	1,23	1,27						
Bco. Cruzeiro do Sul - DPGE	31.546.404,00	31.255.919,98	2,30	0,93						
CDB	15.559.322,94	15.493.944,34	1,13	0,42						
DPGE	15.987.081,06	15.761.975,64	1,17	1,43						
Caixa - LH	6.869.424,90	6.730.062,76	0,50	2,07						
Debêntures Não Conversíveis	23.260.412,59	23.055.748,70	1,69	0,89	20%					
Triunfo	15.262.049,86	15.087.672,82	1,11	1,16						
Ulbra	609.929,86	602.196,74	0,04	1,28						
Sanesalto	7.388.432,87	7.365.879,14	0,54	0,31						
Cédula de Crédito Bancário - CCB	372.221.437,70	366.641.785,65	27,10	1,52	20%	5%				
Aurizônia	92.695.396,84	91.366.355,90	6,75	1,45						
Raesa	98.388.190,54	96.563.859,99	7,15	1,89						
Ucam	35.089.487,47	34.807.874,64	2,56	0,81						
Clima Te	56.648.695,65	55.809.152,78	4,13	1,50						
Realesta	74.278.014,89	73.193.522,52	5,41	1,48						
Tha Cons	6.221.242,46	6.137.222,67	0,45	1,37						
Yama	8.900.409,85	8.763.797,15	0,65	1,56						
Certificados de Recebíveis Imobiliários - CRI	5.600.564,39	5.590.200,95	0,41	0,19						
Altr	305.120,37	299.360,76	0,02	1,92						
Focussec	5.295.444,02	5.290.840,19	0,39	0,09						
Cédula de Crédito Imobiliário - CCI - Atlântico	4.294.657,43	4.278.892,82	0,31	0,37	20%	10%				
Contas a (Pagar) e a Receber	0,00	0,00	0,00	0,00						
Fundos de Investimentos	148.036.350,66	115.171.346,11	10,78	28,54	80%	80%	20%			
Renda Fixa - Planos	121.814.221,27	94.964.481,23	8,87	28,27						
Multimercado - Planos	0,00	0,00	0,00	0,00						
Renda Fixa - Gestão Administrativa	1.608.217,34	1.408.335,40	0,12	14,19						
Renda Variável - Planos	24.613.912,05	18.798.529,48	1,79	30,94						
Contas a (Pagar) e a Receber	0,00	0,00	0,00	0,00						
Renda Variável	381.441.090,14	397.090.360,13	27,77	(3,94)						
Ações	379.219.060,14	387.926.830,13	27,61	(2,24)	70%	10%	25%			
À Vista	238.537.301,00	239.028.653,00	17,38	(0,21)						
Participações do TGMC	37.552.200,00	37.552.200,00	2,73	0,00						
Empréstimo de Ações	0,00	0,00	0,00	0,00						
Debentures com Participação no Lucro	114.241.297,81	114.241.297,81	8,32	0,00						
Debêntures Conversíveis - RV (CRT)	11.992.992,00	11.992.992,00	0,87	0,00						
Debêntures Não Conversíveis - RV (PROMAN)	2.840.862,50	2.840.862,50	0,21	0,00						
Debêntures Não Conversíveis - RV (SPE) (HAUSCENTER)	99.407.443,31	99.407.443,31	7,24	0,00						
Contas a (Pagar) e a Receber	(11.111.738,67)	(2.895.320,68)	(0,81)	283,78						
Derivativos	2.222.030,00	9.163.530,00	0,16	(75,75)	3%					
Mercado a Termo - Ativo	2.459.000,00	2.585.000,00	0,18	(4,87)						
Mercado a Termo - Passivo	(2.692.970,00)	(2.692.970,00)	(0,20)	0,00						
Mercado de Opções	2.456.000,00	9.271.500,00	0,18	(73,51)						
Carteira Lastro	2.459.000,00	9.747.500,00	0,18	(74,77)						
(-)Prêmio	(3.000,00)	(476.000,00)	(0,00)	99,37						
Swap	0,00	0,00	0,00	0,00						
Contas a (Pagar) e a Receber	0,00	0,00	0,00	0,00						
Investimentos Estruturados	0,00	0,00	0,00	0,00				20%	10%	
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00				10%	5%	
Investimentos Imobiliários	91.250.027,29	91.213.405,78	6,65	0,04	8%					
Carteira Imobiliária	90.100.352,79	90.169.533,56	6,56	(0,08)						
Contas a (Pagar) e a Receber	1.149.674,50	1.043.872,22	0,08	10,14						
Empréstimos e Financiamentos	32.755.607,61	32.657.765,89	2,39	0,30	15%					
Carteira de Empréstimos ao Participantes	33.498.803,77	33.147.591,10	2,44	1,06						
Contas a (Pagar) e a Receber	(743.196,16)	(489.825,21)	(0,05)	(51,73)						
Recursos Garantidores das Reservas Técnicas	1.373.246.881,36	1.364.943.361,17	100,00	0,61						

OS VALORES EM AMARELO REPRESENTAM OS DESENQUADRAMENTOS.

Enquadramento das Aplicações

