

Posição em 29 de julho de 2011

Demonstrativo da Carteira de Investimentos	Jul/2011	Jun/2011	% Composição	% Variação	Limites de Alocação Geral	Limites de Alocação Emissor	Limites de Alocação Concentração
Disponibilidades e Outros Realizáveis	17.745.933,59	13.941.434,12	1,28	27,29			
Investimentos	1.367.020.359,28	1.379.106.075,97	98,72	(0,88)			
Renda Fixa	878.046.338,82	878.197.484,64	63,41	(0,12)			
Títulos Públicos	1.100.070,55	317.160.223,93	0,08	(99,65)			
Notas do Tesouro Nacional - NTN-A/NTN-B/NTN-C	1.100.070,55	300.598.957,32	0,08	(99,63)	100%	100%	100%
Créditos Securitizados do Tesouro - SNTC-CFTE	0,00	530.988,07	0,00	(100,00)			
Certificado Financeiro do Tesouro Estadual - STNC-CVS-CRED	0,00	16.030.278,54	0,00	(100,00)			
Créditos Privados e Depósitos	0,00	494.604.159,60	0,00	(100,00)			
Instituições Financeiras (DPGE/CDB e LH)	0,00	171.953.024,74	0,00	(100,00)			
Certificados de Depósito Bancário - CDB	0,00	52.355.689,53	0,00	(100,00)			
Depósito a Prazo com Garantia - DPGE	0,00	112.746.026,60	0,00	(100,00)			
Letras Hipotecárias - LH	0,00	6.851.308,61	0,00	(100,00)			
Classificação por Emissor							
Bco. BMG S/A	0,00	37.835.716,17	0,00	(100,00)			
CDB	0,00	20.105.768,46	0,00	(100,00)			
DPGE	0,00	17.729.947,71	0,00	(100,00)			
Bco. Pan Americano S/A	0,00	33.836.902,50	0,00	(100,00)			
CDB	0,00	15.355.417,92	0,00	(100,00)			
DPGE	0,00	18.481.484,58	0,00	(100,00)			
Bco. Cruzeiro do Sul S/A	0,00	34.345.191,07	0,00	(100,00)			
CDB	0,00	16.894.503,15	0,00	(100,00)			
DPGE	0,00	17.450.687,92	0,00	(100,00)			
Bco. Rural S/A	0,00	10.727.509,80	0,00	(100,00)	80%	20%	20%
DPGE	0,00	10.727.509,80	0,00	(100,00)			
Bco. Matone S/A	0,00	10.464.694,24	0,00	(100,00)			
DPGE	0,00	10.464.694,24	0,00	(100,00)			
Bco. Máxima S/A	0,00	5.638.829,37	0,00	(100,00)	80%		
DPGE	0,00	5.638.829,37	0,00	(100,00)			
Bco. Bom Sucesso S/A	0,00	10.765.037,89	0,00	(100,00)			
DPGE	0,00	10.765.037,89	0,00	(100,00)			
Bco. Semear S/A	0,00	10.765.281,67	0,00	(100,00)			
DPGE	0,00	10.765.281,67	0,00	(100,00)			
Bco. JBS S/A	0,00	10.722.553,42	0,00	(100,00)			
DPGE	0,00	10.722.553,42	0,00	(100,00)			
Caixa - LH	0,00	6.851.308,61	0,00	(100,00)			
Debêntures Não Conversíveis	0,00	17.511.493,49	0,00	(100,00)			
Triunfo	0,00	10.608.399,47	0,01	(100,00)		20%	
Sanesalto	0,00	6.903.094,02	0,00	(100,00)			
Cédula de Crédito Bancário - CCB	0,00	295.881.324,53	0,00	(100,00)			
Aurizônia	0,00	101.018.826,90	0,00	(100,00)			
Raesa	0,00	102.760.018,03	0,00	(100,00)			
Ucam	0,00	35.504.232,82	0,00	(100,00)		20%	5%
Realesta	0,00	41.033.952,65	0,00	(100,00)			
Tha Cons	0,00	5.678.358,93	0,00	(100,00)			
Yama	0,00	9.885.935,20	0,00	(100,00)			
Certificados de Recebíveis Imobiliários - CRI	0,00	4.975.981,42	0,00	(100,00)			
Altr	0,00	335.618,88	0,00	(100,00)		20%	10%
Focussec	0,00	4.640.362,54	0,00	(100,00)			
Cédula de Crédito Imobiliário - CCI - Atlântico	0,00	4.282.335,42	0,00	(100,00)		20%	10%
Fundos de Investimentos	876.946.268,27	66.433.101,11	63,33	1.220,04	80%	80%	20%
Renda Fixa - Planos	0,00	66.433.101,11	0,00	(100,00)			10%
Multimercado - Planos	876.946.268,27	0,00	63,33	0,00			
Renda Variável	348.177.902,69	359.685.061,20	25,14	(3,20)			
Ações	0,00	334.561.785,60	0,00	(100,00)			
À Vista	0,00	181.917.375,18	0,00	(100,00)	70%	10%	
Participações do TGMC	0,00	37.552.200,00	0,00	(100,00)			25%
Debentures com Participação no Lucro	0,00	114.241.297,81	0,00	(100,00)			
Debêntures Conversíveis - RV (CRT)	0,00	11.992.992,00	0,00	(100,00)			
Debêntures Não Conversíveis - RV (PROMAN)	0,00	2.840.862,50	0,00	(100,00)	3%	10%	
Debêntures Não Conversíveis - RV (SPE) (HAUSCENTER)	0,00	99.407.443,31	0,00	(100,00)			
Contas a (Pagar) e a Receber	0,00	850.912,61	0,01	(100,00)			
Derivativos	0,00	0,00	0,00	0,00			
Contas a (Pagar) e a Receber	0,00	0,00	0,00	0,00			
Fundos de Investimentos	348.177.902,69	25.123.275,60	25,14	1.285,88	80%	80%	20%
Renda Variável - Planos	0,00	25.123.275,60	0,00	(100,00)			10%
Multimercado - Planos	348.177.902,69	0,00	25,14	0,00			
Investimentos Estruturados	0,00	0,00	0,00	0,00		20%	
Investimentos no Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00		10%	
Investimentos Imobiliários	110.003.062,44	110.105.147,61	7,94	(0,09)			
Carteira Imobiliária	109.259.327,30	109.389.854,21	7,89	(0,12)	8%		
Contas a (Pagar) e a Receber	743.735,14	715.293,40	0,05	3,98			
Empréstimos e Financiamentos	30.793.055,33	31.118.382,52	2,22	(1,05)			
Carteira de Empréstimos a Participantes	31.126.137,93	32.675.003,39	2,25	(4,74)	15%		
Contas a (Pagar) e a Receber	(333.082,60)	(1.556.620,87)	(0,02)	78,60			
Recursos Garantidores das Reservas Técnicas dos Planos Previdenciários	1.384.766.292,87	1.393.047.510,09	100,00	(0,59)			
Fundos de Investimentos	989.367,31	1.405.529,00	0,07	(29,61)	80%	80%	20%
Renda Fixa - Gestão Administrativa	989.367,31	1.405.529,00	0,07	(29,61)			10%
Recursos Garantidores das Reservas Técnicas dos Planos Previdenciários e PGA	1.385.755.660,18	1.394.453.039,09	100,00	(0,62)			

OS VALORES EM AMARELO REPRESENTAM OS DESEQUADRAMENTOS.

Recursos Garantidores das Reservas Técnicas dos Planos Previdenciários

