

## Fundo de Investimento Financeiro Carteira Corporativa 7

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) – CNPJ Nº 03.573.876/0001-15

| DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 (em milhares de reais) |                    |                        |
|--|--------------------|------------------------|
| <b>Aplicações/especificações</b>   | <b>Valor atual</b> | <b>% sobre o ativo</b> |
| <b>TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS</b>   |                    |                        |
| <b>TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS</b>   |                    |                        |
| Letras Financeiras do Tesouro – LFT  | 6.454              | 82,00                  |
| <b>QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO</b>  |                    |                        |
| Fundo de Investimento Financeiro Portfólio 1   | 708                | 8,99                   |
| Fundo de Investimento Financeiro Portfólio 2   | 709                | 9,01                   |
| <b>TOTAL DA CARTEIRA</b>   | <b>14.117</b>      | <b>18,00</b>           |
| <b>DISPONIBILIDADES</b>  | <b>7.871</b>       | <b>100,00</b>          |
| <b>DEVEDORES DIVERSOS</b>  | <b>1</b>           | <b>0,02</b>            |
| <b>EXIGIBILIDADES</b>  | <b>1</b>           | <b>0,00</b>            |
| <b>VALORES A PAGAR</b>   |                    |                        |
| Provisão para pagamentos a efetuar   | 5                  |                        |
| Taxa de administração  | 3                  |                        |
| <b>Credores diversos</b>   | <b>8</b>           |                        |

| DEMONSTRAÇÃO DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO (em milhares de reais)    |   |   |
|--|---|---|
| <b>Patrimônio líquido no início do exercício/periodo</b>                 | <b>Exercício findo em 31 de março de 2001</b> | <b>Período de 25 de janeiro a 31 de março de 2000</b> |
| Saldos inicial 91.388.515 quotas de R\$ 1,0341                           | 94.508  | 100.000   |
| (Constituição 100.000.000 quotas de R\$ 1,0000)                          |   |   |
| Quotas emitidas 61.978.429   | 69.257  |   |
| Quotas resgatadas 146.837.084  | (151.645)                                     | (7.972)   |
| (2000 8.611.485)   | (15.377)                                      | (821)   |
| Variação no resgate de quotas  | (15.377)                                      | (821)   |
| <b>Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/periodo</b>        | <b>(3.257)</b>                                | <b>91.207</b>   |
| <b>Resultado do exercício/periodo</b>                                    |   |   |
| <b>Receitas</b>  |   |   |
| Rendimentos de títulos e valores mobiliários                             | 11.079  | 3.341   |
| Rendimentos de aplicações interfinanceiras de liquidez                   | 201   | 3.341   |
| <b>Despesas</b>  |   |   |
| Taxa de administração  | 143   | 3.341   |
| Administrativas  | 16  | 4   |
| <b>Credores diversos</b>   | <b>159</b>                                    | <b>40</b>   |
| <b>Resultado do exercício/periodo apropriado a resultados acumulados</b> | <b>11.121</b>                                 | <b>3.301</b>  |
| <b>Patrimônio líquido no final do exercício/periodo</b>                  |   |   |
| Representado por 6.529.860 quotas de R\$ 1,2043                          | 7.864   | 94.508  |
| (2000 91.388.515 quotas de R\$ 1,0341)                                   |   |   |

As notas explicativas do administrador são parte integrante das demonstrações financeiras.

| DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 E DE 2000 (em milhares de reais)  |  |  |
|---|--|--|
| <b>1. Contexto operacional</b>  |  |  |
| O Fundo de Investimento Financeiro Carteira Corporativa 7 foi constituído de acordo com a Resolução nº 2.183, do Conselho Monetário Nacional, e Circular nº 2.616, do Banco Central do Brasil e iniciou suas operações em 25 de janeiro de 2000. Sua finalidade é possibilitar aos investidores a participação em uma carteira diversificada de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro. Os investidores podem incorrer em perda do capital investido em decorrência de oscilações do mercado financeiro ou da aplicação da política de investimento adotada pelo administrador da carteira, previsto no regulamento do fundo. |  |  |

| DEMONSTRAÇÃO DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO (em milhares de reais)    |   |   |
|--|---|---|
| <b>Patrimônio líquido no início do exercício/periodo</b>                 | <b>Exercício findo em 31 de março de 2001</b> | <b>Período de 17 de fevereiro de 1999 a 31 de março de 2000</b> |
| Saldos inicial 91.388.515 quotas de R\$ 1,0341                           | 94.508  | 100.000   |
| (Constituição 100.000.000 quotas de R\$ 1,0000)                          |   |   |
| Quotas emitidas 61.978.429   | 69.257  |   |
| Quotas resgatadas 146.837.084  | (151.645)                                     | (7.972)   |
| (2000 8.611.485)   | (15.377)                                      | (821)   |
| Variação no resgate de quotas  | (15.377)                                      | (821)   |
| <b>Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/periodo</b>        | <b>(3.257)</b>                                | <b>91.207</b>   |
| <b>Resultado do exercício/periodo</b>                                    |   |   |
| <b>Receitas</b>  |   |   |
| Rendimentos de títulos e valores mobiliários                             | 11.079  | 3.341   |
| Rendimentos de aplicações interfinanceiras de liquidez                   | 201   | 3.341   |
| <b>Despesas</b>  |   |   |
| Taxa de administração  | 143   | 3.341   |
| Administrativas  | 16  | 4   |
| <b>Credores diversos</b>   | <b>159</b>                                    | <b>40</b>   |
| <b>Resultado do exercício/periodo apropriado a resultados acumulados</b> | <b>11.121</b>                                 | <b>3.301</b>  |
| <b>Patrimônio líquido no final do exercício/periodo</b>                  |   |   |
| Representado por 6.529.860 quotas de R\$ 1,2043                          | 7.864   | 94.508  |
| (2000 91.388.515 quotas de R\$ 1,0341)                                   |   |   |

As notas explicativas do administrador são parte integrante das demonstrações financeiras.

| NOTAS EXPLICATIVAS DO ADMINISTRADOR ÀS DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS EM 31 DE MARÇO DE 2001 E DE 2000 (em milhares de reais)  |  |  |
|---|--|--|
| <b>1. Contexto operacional</b>  |  |  |
| O Fundo de Investimento Financeiro Carteira Corporativa 7 foi constituído de acordo com a Resolução nº 2.183, do Conselho Monetário Nacional, e Circular nº 2.616, do Banco Central do Brasil e iniciou suas operações em 25 de janeiro de 2000. Sua finalidade é possibilitar aos investidores a participação em uma carteira diversificada de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro. Os investidores podem incorrer em perda do capital investido em decorrência de oscilações do mercado financeiro ou da aplicação da política de investimento adotada pelo administrador da carteira, previsto no regulamento do fundo. |  |  |

| DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 (em milhares de reais)                       |                    |                        |
|--|--------------------|------------------------|
| <b>Aplicações/especificações</b>   | <b>Valor atual</b> | <b>% sobre o ativo</b> |
| <b>TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS</b>   |                    |                        |
| <b>TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS</b>   |                    |                        |
| Letras Financeiras do Tesouro – LFT  | 8.255              | 8,16                   |
| Letras do Tesouro Nacional – NTN   | 42.293             | 41,81                  |
| Notas do Banco Central – NBC   | 62.085             | 61,37                  |
| <b>DEBÊNTURES</b>  |                    |                        |
| Certificado de Depósito Bancário – CDB   | 4.413              | 4,36                   |
| ABN Amro Bank S.A.   | 3.041              | 3,01                   |
| Banco Bilbao Vizcaya Brasil S.A.   | 2.022              | 2,00                   |
| <b>COMERCIAL PAPER</b>   |                    |                        |
| Centrais S.A. Linhas Aéreas  | 14.482             | 14,32                  |
| Centrais Elétricas Brasileiras S.A. – Eletrobrás   | 12.606             | 12,46                  |
| <b>CERTIFICADO DE PRIVATIZAÇÃO</b>   | <b>27.088</b>      | <b>26,78</b>           |
| Superintendência Nacional do Mercado Mercantil – Sunam   | 2.307              | 2,28                   |
| Superintendência Nacional de Custódia e de Liquidação Financeira de Títulos – CETIP e no Bolsa de Mercadorias & Futuros – BM&F | 100.962            | 99,80                  |
| <b>NEGOCIAÇÃO E INTERMEDIÇÃO DE VALORES</b>  |                    |                        |
| Operações de "Swap" – diferencial a receber  | 198                | 0,20                   |
| <b>EXIGIBILIDADES</b>  | <b>101.162</b>     | <b>100,00</b>          |
| <b>VALORES A PAGAR</b>   |                    |                        |
| Provisão para pagamentos a efetuar   | 1                  |                        |
| Taxa de administração  | 4                  |                        |
| <b>Credores diversos</b>   | <b>52</b>          |                        |
| <b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO</b>  | <b>101.105</b>     |                        |
| Representado por 33.419.503 quotas de R\$ 3,0253   | 101.162            |                        |

As notas explicativas do administrador são parte integrante das demonstrações financeiras.

| DEMONSTRAÇÕES DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO (em milhares de reais)   |   |   |
|--|---|---|
| <b>Patrimônio líquido no início do exercício/periodo</b>                 | <b>Exercício findo em 31 de março de 2001</b> | <b>Período de 17 de fevereiro de 1999 a 31 de março de 2000</b> |
| Representado por 33.419.503 quotas de R\$ 3,0253                         | 82.450  | 66,601  |
| (1999 – Constituição 27.514.902 quotas de R\$ 2,4206)                    |   |   |
| (2000 5.904.601)   |   |   |
| Variação no resgate de quotas  |   |   |
| <b>Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/periodo</b>        | <b>82.450</b>                                 | <b>81,169</b>   |
| <b>Resultado do exercício/periodo</b>                                    |   |   |
| <b>Receitas</b>  |   |   |
| Rendimentos de títulos e valores mobiliários                             | 21.687  | 1,291   |
| Rendimentos de aplicações interfinanceiras de liquidez                   | 15  |   |
| <b>Despesas</b>  |   |   |
| Taxa de administração  | 21.703  | 1,291   |
| Administrativas  | 2   |   |
| <b>Credores diversos</b>   | <b>3.048</b>                                  | <b>10,105</b>   |
| <b>Resultado do exercício/periodo apropriado a resultados acumulados</b> | <b>18.655</b>                                 | <b>1,281</b>  |
| <b>Patrimônio líquido no final do exercício/periodo</b>                  |   |   |
| Representado por 33.419.503 quotas de R\$ 3,0253                         | 101.105                                       | 82.450  |
| (2000 33.419.503 quotas de R\$ 3,0253)                                   |   |   |

As notas explicativas do administrador são parte integrante das demonstrações financeiras.

| NOTAS EXPLICATIVAS DO ADMINISTRADOR ÀS DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS EM 31 DE MARÇO DE 2001 E DE 2000 (em milhares de reais)   |  |  |
|--|--|--|
| <b>1. Contexto operacional</b>   |  |  |
| O Fundo de Investimento Financeiro Investor Seis foi constituído de acordo com a Resolução nº 2.183, do Conselho Monetário Nacional, e Circular nº 2.616, do Banco Central do Brasil e iniciou suas operações em 17 de fevereiro de 2000. Sua finalidade é possibilitar aos investidores a participação em uma carteira diversificada de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro. Os investidores podem incorrer em perda do capital investido em decorrência de oscilações do mercado financeiro ou da aplicação da política de investimento adotada pelo administrador da carteira, previsto no regulamento do fundo. As aplicações realizadas no Fundo não contam com garantia da instituição administradora ou do Fundo Garantidor de Créditos – FGC. |  |  |

| DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 (em milhares de reais)                       |                    |                        |
|--|--------------------|------------------------|
| <b>Aplicações/especificações</b>   | <b>Valor atual</b> | <b>% sobre o ativo</b> |
| <b>TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS</b>   |                    |                        |
| <b>TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS</b>   |                    |                        |
| Letras Financeiras do Tesouro – LFT  | 8.255              | 8,16                   |
| Letras do Tesouro Nacional – NTN   | 42.293             | 41,81                  |
| Notas do Banco Central – NBC   | 62.085             | 61,37                  |
| <b>DEBÊNTURES</b>  |                    |                        |
| Certificado de Depósito Bancário – CDB   | 4.413              | 4,36                   |
| ABN Amro Bank S.A.   | 3.041              | 3,01                   |
| Banco Bilbao Vizcaya Brasil S.A.   | 2.022              | 2,00                   |
| <b>COMERCIAL PAPER</b>   |                    |                        |
| Centrais S.A. Linhas Aéreas  | 14.482             | 14,32                  |
| Centrais Elétricas Brasileiras S.A. – Eletrobrás   | 12.606             | 12,46                  |
| <b>CERTIFICADO DE PRIVATIZAÇÃO</b>   | <b>27.088</b>      | <b>26,78</b>           |
| Superintendência Nacional do Mercado Mercantil – Sunam   | 2.307              | 2,28                   |
| Superintendência Nacional de Custódia e de Liquidação Financeira de Títulos – CETIP e no Bolsa de Mercadorias & Futuros – BM&F | 100.962            | 99,80                  |
| <b>NEGOCIAÇÃO E INTERMEDIÇÃO DE VALORES</b>  |                    |                        |
| Operações de "Swap" – diferencial a receber  | 198                | 0,20                   |
| <b>EXIGIBILIDADES</b>  | <b>101.162</b>     | <b>100,00</b>          |
| <b>VALORES A PAGAR</b>   |                    |                        |
| Provisão para pagamentos a efetuar   | 1                  |                        |
| Taxa de administração  | 4                  |                        |
| <b>Credores diversos</b>   | <b>52</b>          |                        |
| <b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO</b>  | <b>101.105</b>     |                        |
| Representado por 33.419.503 quotas de R\$ 3,0253   | 101.162            |                        |

As notas explicativas do administrador são parte integrante das demonstrações financeiras.

| DEMONSTRAÇÕES DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO (em milhares de reais)   |   |   |
|--|---|---|
| <b>Patrimônio líquido no início do exercício/periodo</b>                 | <b>Exercício findo em 31 de março de 2001</b> | <b>Período de 17 de fevereiro de 1999 a 31 de março de 2000</b> |
| Representado por 33.419.503 quotas de R\$ 3,0253                         | 82.450  | 66,601  |
| (1999 – Constituição 27.514.902 quotas de R\$ 2,4206)                    |   |   |
| (2000 5.904.601)   |   |   |
| Variação no resgate de quotas  |   |   |
| <b>Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/periodo</b>        | <b>82.450</b>                                 | <b>81,169</b>   |
| <b>Resultado do exercício/periodo</b>                                    |   |   |
| <b>Receitas</b>  |   |   |
| Rendimentos de títulos e valores mobiliários                             | 21.687  | 1,291   |
| Rendimentos de aplicações interfinanceiras de liquidez                   | 15  |   |
| <b>Despesas</b>  |   |   |
| Taxa de administração  | 21.703  | 1,291   |
| Administrativas  | 2   |   |
| <b>Credores diversos</b>   | <b>3.048</b>                                  | <b>10,105</b>   |
| <b>Resultado do exercício/periodo apropriado a resultados acumulados</b> | <b>18.655</b>                                 | <b>1,281</b>  |
| <b>Patrimônio líquido no final do exercício/periodo</b>                  |   |   |
| Representado por 33.419.503 quotas de R\$ 3,0253                         | 101.105                                       | 82.450  |
| (2000 33.419.503 quotas de R\$ 3,0253)                                   |   |   |

As notas explicativas do administrador são parte integrante das demonstrações financeiras.

| NOTAS EXPLICATIVAS DO ADMINISTRADOR ÀS DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS EM 31 DE MARÇO DE 2001 E DE 2000 (em milhares de reais)   |  |  |
|--|--|--|
| <b>1. Contexto operacional</b>   |  |  |
| O Fundo de Investimento Financeiro Investor Seis foi constituído de acordo com a Resolução nº 2.183, do Conselho Monetário Nacional, e Circular nº 2.616, do Banco Central do Brasil e iniciou suas operações em 17 de fevereiro de 2000. Sua finalidade é possibilitar aos investidores a participação em uma carteira diversificada de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro. Os investidores podem incorrer em perda do capital investido em decorrência de oscilações do mercado financeiro ou da aplicação da política de investimento adotada pelo administrador da carteira, previsto no regulamento do fundo. As aplicações realizadas no Fundo não contam com garantia da instituição administradora ou do Fundo Garantidor de Créditos – FGC. |  |  |

| DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 (em milhares de reais)                       |                    |                        |
|--|--------------------|------------------------|
| <b>Aplicações/especificações</b>   | <b>Valor atual</b> | <b>% sobre o ativo</b> |
| <b>TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS</b>   |                    |                        |
| <b>TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS</b>   |                    |                        |
| Letras Financeiras do Tesouro – LFT  | 8.255              | 8,16                   |
| Letras do Tesouro Nacional – NTN   | 42.293             | 41,81                  |
| Notas do Banco Central – NBC   | 62.085             | 61,37                  |
| <b>DEBÊNTURES</b>  |                    |                        |
| Certificado de Depósito Bancário – CDB   | 4.413              | 4,36                   |
| ABN Amro Bank S.A.   | 3.041              | 3,01                   |
| Banco Bilbao Vizcaya Brasil S.A.   | 2.022              | 2,00                   |
| <b>COMERCIAL PAPER</b>   |                    |                        |
| Centrais S.A. Linhas Aéreas  | 14.482             | 14,32                  |
| Centrais Elétricas Brasileiras S.A. – Eletrobrás   | 12.606             | 12,46                  |
| <b>CERTIFICADO DE PRIVATIZAÇÃO</b>   | <b>27.088</b>      | <b>26,78</b>           |
| Superintendência Nacional do Mercado Mercantil – Sunam   | 2.307              | 2,28                   |
| Superintendência Nacional de Custódia e de Liquidação Financeira de Títulos – CETIP e no Bolsa de Mercadorias & Futuros – BM&F | 100.962            | 99,80                  |
| <b>NEGOCIAÇÃO E INTERMEDIÇÃO DE VALORES</b>  |                    |                        |
| Operações de "Swap" – diferencial a receber  | 198                | 0,20                   |
| <b>EXIGIBILIDADES</b>  | <b>101.162</b>     | <b>100,00</b>          |
| <b>VALORES A PAGAR</b>   |                    |                        |
| Provisão para pagamentos a efetuar   | 1                  |                        |
| Taxa de administração  | 4                  |                        |
| <b>Credores diversos</b>   | <b>52</b>          |                        |
| <b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO</b>  | <b>101.105</b>     |                        |
| Representado por 33.419.503 quotas de R\$ 3,0253   | 101.162            |                        |

As notas explicativas do administrador são parte integrante das demonstrações financeiras.

| DEMONSTRAÇÕES DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO (em milhares de reais)   |   |   |
|--|---|---|
| <b>Patrimônio líquido no início do exercício/periodo</b>                 | <b>Exercício findo em 31 de março de 2001</b> | <b>Período de 17 de fevereiro de 1999 a 31 de março de 2000</b> |
| Representado por 33.419.503 quotas de R\$ 3,0253                         | 82.450  | 66,601  |
| (1999 – Constituição 27.514.902 quotas de R\$ 2,4206)                    |   |   |
| (2000 5.904.601)   |   |   |
| Variação no resgate de quotas  |   |   |
| <b>Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/periodo</b>        | <b>82.450</b>                                 | <b>81,169</b>   |
| <b>Resultado do exercício/periodo</b>                                    |   |   |
| <b>Receitas</b>  |   |   |
| Rendimentos de títulos e valores mobiliários                             | 21.687  | 1,291   |
| Rendimentos de aplicações interfinanceiras de liquidez                   | 15  |   |
| <b>Despesas</b>  |   |   |
| Taxa de administração  | 21.703  | 1,291   |
| Administrativas  | 2   |   |
| <b>Credores diversos</b>   | <b>3.048</b>                                  | <b>10,105</b>   |
| <b>Resultado do exercício/periodo apropriado a resultados acumulados</b> | <b>18.655</b>                                 | <b>1,281</b>  |
| <b>Patrimônio líquido no final do exercício/periodo</b>                  |   |   |
| Representado por 33.419.503 quotas de R\$ 3,0253                         | 101.105                                       | 82.450  |
| (2000 33.419.503 quotas de R\$ 3,0253)                                   |   |   |

As notas explicativas do administrador são parte integrante das demonstrações financeiras.

| NOTAS EXPLICATIVAS DO ADMINISTRADOR ÀS DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS EM 31 DE MARÇO DE 2001 E DE 2000 (em milhares de reais)   |  |  |
|--|--|--|
| <b>1. Contexto operacional</b>   |  |  |
| O Fundo de Investimento Financeiro Investor Seis foi constituído de acordo com a Resolução nº 2.183, do Conselho Monetário Nacional, e Circular nº 2.616, do Banco Central do Brasil e iniciou suas operações em 17 de fevereiro de 2000. Sua finalidade é possibilitar aos investidores a participação em uma carteira diversificada de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro. Os investidores podem incorrer em perda do capital investido em decorrência de oscilações do mercado financeiro ou da aplicação da política de investimento adotada pelo administrador da carteira, previsto no regulamento do fundo. As aplicações realizadas no Fundo não contam com garantia da instituição administradora ou do Fundo Garantidor de Créditos – FGC. |  |  |

| DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 (em milhares de reais)                       |                    |                        |
|--|--------------------|------------------------|
| <b>Aplicações/especificações</b>   | <b>Valor atual</b> | <b>% sobre o ativo</b> |
| <b>TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS</b>   |                    |                        |
| <b>TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS</b>   |                    |                        |
| Letras Financeiras do Tesouro – LFT  | 8.255              | 8,16                   |
| Letras do Tesouro Nacional – NTN   | 42.293             | 41,81                  |
| Notas do Banco Central – NBC   | 62.085             | 61,37                  |
| <b>DEBÊNTURES</b>  |                    |                        |
| Certificado de Depósito Bancário – CDB   | 4.413              | 4,36                   |
| ABN Amro Bank S.A.   | 3.041              | 3,01                   |
| Banco Bilbao Vizcaya Brasil S.A.   | 2.022              | 2,00                   |
| <b>COMERCIAL PAPER</b>   |                    |                        |
| Centrais S.A. Linhas Aéreas  | 14.482             | 14,32                  |
| Centrais Elétricas Brasileiras S.A. – Eletrobrás   | 12.606             | 12,46                  |
| <b>CERTIFICADO DE PRIVATIZAÇÃO</b>   | <b>27.088</b>      | <b>26,78</b>           |
| Superintendência Nacional do Mercado Mercantil – Sunam   | 2.307              | 2,28                   |
| Superintendência Nacional de Custódia e de Liquidação Financeira de Títulos – CETIP e no Bolsa de Mercadorias & Futuros – BM&F | 100.962            | 99,80                  |
| <b>NEGOCIAÇÃO E INTERMEDIÇÃO DE VALORES</b>  |                    |                        |
| Operações de "Swap" – diferencial a receber  | 198                | 0,20                   |
| <b>EXIGIBILIDADES</b>  | <b>101.162</b>     | <b>100,00</b>          |
| <b>VALORES A PAGAR</b>   |                    |                        |
| Provisão para pagamentos a efetuar   | 1                  |                        |
|  |                    |                        |