

DIVISION MERCADO DE VALORES Y CONTROL DE ADMINISTRADORAS DE FONDOS DE AHORRO PREVISIONAL

Area de Control Operacional - Departamento de Control Financiero

COMPOSICION DEL ACTIVO DE LOS FONDOS DE AHORRO PREVISIONAL AL

31/08/2006

(en porcentaje)

		AFINIDAD	INTEGRACION	REPUBLICA	UNION CAPITAL	TOTAL DEL SISTEMA
D. TRANSITORIA		1,01%	1,16%	2,56%	0,09%	1,73%
LITERAL A	BONO DE TESORO	US 7,56%	6,36%	4,09%	4,64%	5,00%
	BONO EXT REAJ	UY 3,84%	1,40%	2,83%	1,84%	2,72%
	BONO GLOBAL	CL 0,00%	0,00%	0,24%	0,00%	0,13%
		EU 3,68%	2,11%	2,24%	3,75%	2,75%
		US 22,86%	22,30%	25,34%	26,81%	24,89%
	BONO PREVISION	UR 0,15%	0,08%	0,05%	0,00%	0,06%
	BONO SAMURAI	JP 0,00%	0,00%	0,00%	0,85%	0,15%
	BONOS DE TESORO	UI 11,13%	14,49%	10,42%	12,21%	11,20%
	LETRA TESORERIA	UI 0,00%	1,19%	0,00%	0,00%	0,10%
		US 0,17%	0,23%	0,00%	0,00%	0,05%
		UY 0,00%	0,00%	0,19%	0,00%	0,10%
	NOTAS DE TESORO	UI 8,20%	8,43%	13,23%	9,59%	11,29%
Total LITERAL A		57,59%	56,59%	58,62%	59,69%	58,45%
LITERAL B	BONOS BHU	US 0,59%	0,63%	0,72%	1,39%	0,81%
	LETRAS REG.MON.	UI 26,85%	24,92%	19,10%	27,24%	22,39%
		UY 1,18%	1,16%	5,00%	0,91%	3,28%
Total LITERAL B		28,61%	26,71%	24,82%	29,54%	26,48%
LITERAL C	CERT DEP EFECT.	UI 0,00%	0,00%	1,20%	1,17%	0,88%
		UY 3,00%	3,69%	1,18%	1,60%	1,79%
	CERT DEPOSITO	US 6,71%	7,59%	7,03%	4,90%	6,65%
	CERT.DEP.BONO	UI 0,09%	0,00%	0,11%	0,09%	0,09%
Total LITERAL C		9,80%	11,27%	9,52%	7,77%	9,41%
Total LITERAL D		0,81%	2,12%	1,87%	0,75%	1,51%
Total LITERAL E		1,13%	1,10%	1,15%	1,12%	1,14%
Total LITERAL F		1,05%	1,05%	1,47%	1,05%	1,29%
Totales		100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%
TOTAL ACTIVOS DEL F.A.P. (\$)		10.325.749.785	4.879.260.773	32.330.329.138	9.986.575.625	57.521.915.321
TOTAL RESERVA ESPECIAL (\$)		52.031.313	24.605.056	166.088.531	51.995.351	294.720.251
TOTAL FONDO DE AHORRO PREVISIONAL (\$)		10.273.718.472	4.854.655.717	32.164.240.607	9.934.580.274	57.227.195.070
PARTICIPACION EN EL TOTAL DEL F.A.P.		17,95%	8,48%	56,21%	17,36%	100,00%

NOTA: La suma de cifras parciales puede no coincidir con el total por razones de redondeo

ANEXO

**DETALLE DE LOS INSTRUMENTOS QUE COMPONEN LOS LITERALES A Y B CON PARTICIPACIÓN
MAYOR O IGUAL AL 2% DEL FAP**

31/08/06

COMPOSICIÓN LITERAL 'A'

TIPO DE INSTRUMENTO	INSTRUMENTO	MONEDA	% S/ACT FAP	TOT. SISTEMA %
BONOS DEL TESORO (BT - BL)	BT 00060UI1EUIF	UI	11,10%	
	INSTRUMENTOS VARIOS	UI	0,10%	
	INSTRUMENTOS VARIOS	US	5,00%	
	SUB TOTAL			16,20%
BONOS EXTERNOS REAJUSTABLES (BEUY)	BEUY 00060 R061020EUYF	UY	2,72%	
	SUB TOTAL			2,72%
BONOS GLOBALES (BE)	INSTRUMENTOS VARIOS	CL	0,13%	
	INSTRUMENTOS VARIOS	EU	2,75%	
	BE 00060 F221118EUSF	US	2,51%	
	BE 00060 P330115EUSF	US	15,59%	
	INSTRUMENTOS VARIOS	US	6,79%	
SUB TOTAL			27,77%	
BONOS BREVISIONALES (BP)	INSTRUMENTOS VARIOS	UR	0,06%	
	SUB TOTAL			0,06%
BONO SAMURAI (BJP)	INSTRUMENTOS VARIOS	JP	0,15%	
	SUB TOTAL			0,15%
LETRA TESORERIA	INSTRUMENTOS VARIOS	UI	0,10%	
	SUB TOTAL			0,10%
LETRA TESORERIA	INSTRUMENTOS VARIOS	US	0,05%	
	INSTRUMENTOS VARIOS	UY	0,10%	
	SUB TOTAL			0,15%
NOTAS DEL TESORO (NAUI)	NAUI 0006000002EUIF20141223	UI	3,42%	
	NAUI 0006000008EUIF20110616	UI	2,03%	
	INSTRUMENTOS VARIOS	UI	5,84%	
	SUB TOTAL			11,29%
TOTAL INSTRUMENTOS LITERAL 'A'			58,45%	58,45%

COMPOSICIÓN LITERAL 'B'

TIPO DE INSTRUMENTO	INSTRUMENTO	MONEDA	% S/ACT FAP	TOT. SISTEMA %
BONOS HIPOTECARIOS (BH)	INSTRUMENTOS VARIOS	US	0,81%	
	SUB TOTAL			0,81%
LETRAS DE REGULACIÓN MONETARIA (LBUI)	LBUI 0006000010EUIF20090806	UI	2,07%	
	LBUI 0006000015EUIF20150513	UI	3,09%	
	LBUI 0006000016EUIF20150812	UI	2,71%	
	LBUI 0006000017EUIF20151104	UI	3,21%	
	LBUI 0006000018EUIF20160421	UI	3,54%	
	INSTRUMENTOS VARIOS	UI	7,77%	
	SUB TOTAL			22,39%
LETRAS DE REGULACIÓN MONETARIA CUPÓN 0 (LRM Y LRUI)	INSTRUMENTOS VARIOS	UY	3,28%	
	SUB TOTAL			3,28%
TOTAL INSTRUMENTOS LITERAL 'B'			26,48%	26,48%

NOTA: La suma de cifras parciales puede no coincidir con el total por razones de redondeo