

DAIEA - Demonstrativo Analítico de Investimentos e de Enquadramento das Aplicações 1º. Trimestre de 2006

Em atendimento ao disposto na Resolução CMN Nº. 3.121, de 25 de setembro de 2003, e a Instrução Normativa da Secretaria de Previdência Complementar Nº 44, de 23 de dezembro de 2002, apresentamos o DAIEA resumido e consolidado dos investimentos da FIPECq.

Distribuição dos Investimentos por Segmento				
Segmentos	Março/2006		Março/2005	
	Valor	(%)	Valor	(%)
Renda Fixa	413,108,554.82	73.92	333,989,219.29	72.58
Renda Variável	84,031,857.79	15.04	78,267,672.49	17.01
Imóveis	13,689,326.34	2.45	10,465,165.58	2.27
Empréstimos e Financiamentos	48,016,326.90	8.59	37,479,296.63	8.14
Total de Investimentos	558,846,065.85	100.00	460,201,353.99	100.00

Rentabilidade dos Segmentos (Modelo de Cotas)			Índice de Performance	
Segmentos	Valor da Cota	Rentab.Trimestre(%)	Benchmark	Rentab.Trimestre(%)
Renda Fixa	230.384450	3.97	Taxa CDI CETIP	4.04
Renda Variável	413.421700	10.76	IBOVESPA Médio	13.70
Imóveis	197.008260	2.53	INPC + 6% a.a.	2.36
Empréstimos e Financiamentos	238.792290	3.35	INPC + 6% a.a.	2.36

Planos	Valor	(%)
Plano de Previdência Complementar- PPC	499,246,892.66	89.26
Plano de Previdência Especial - PPE	21,857,368.27	3.85
Plano Administrativo	37,741,804.92	6.89
Total de Investimentos	558,846,065.85	100.00

Planos de Benefícios	Rentabilidade Trimestre (%)*	Meta Atuarial(%)
Plano de Previdência Complementar- PPC	4.88	2.36
Plano de Previdência Especial - PPE	4.88	2.36

* Apurada pela cota contábil de Segregação dos Investimentos

Composição do Segmento Renda Fixa		
Títulos Públicos		
Espécie	Valor Mercado	(%).s/Segmento
Notas do Tesouro Nacional - NTN	58,382,478.83	14.13
Letras Financeiras do Tesouro - LFT	32,120,675.00	7.78
Títulos da Dívida Agrária - TDA	4,807,523.75	1.16
Créditos Securitizados do Tesouro Nacional - CTN	857,398.79	0.21
Total	96,168,076.37	23.28
Títulos Privados		
Espécie	Valor Mercado	(%).s/Segmento
Certificados de Depósitos Bancários - CDB	52,168,321.93	12.63
Debêntures não Conversíveis - D/NC	18,811,331.26	4.55
Certificado de Compra/Venda a Termo de Energia - CTE	2,636,804.74	0.64
Total	73,616,457.93	17.82
Fundos de Renda Fixa		
Fundos	Valor Mercado	(%).s/Segmento
Fundos de Investimento Financeiro - FIF	232,759,376.57	56.35
BRB - Mercado	91,102,079.93	22.05
BNP Paribas Optimun DI	35,944,861.10	8.70
Insigna FIF Multimercado	66,424,037.23	16.08
Profix Institucional Multimercado	469,837.15	0.12
Protecq Fundo de Investimento Multimercado	17,400,846.91	4.21
Pactual Yield DI	21,417,714.25	5.19
Fundos de Investimento em Direito Creditório - FIDC	5,132,988.50	1.23
Bancoop	2,516,973.32	0.61
Bonsucesso	2,115,087.48	0.50
Chemical	500,927.70	0.12
Total	237,892,365.07	57.58

Valores a Receber / Pagar

Descrição	Valor	(%). s/Segmento
Valores a Receber	34,008,020.38	8.23
Certificado de Depósito Bancário	8,392,239.42	2.03
Banco Santos S/A	8,392,239.42	2.03
Debêntures não Conversíveis	19,761,056.55	4.78
Crefisul Leasing S/A, Arrendamento Mercantil	2,478,003.90	0.60
Encol S/A, Engenharia, Comercio e Indústria	10,117,738.94	2.45
Inepar S/A, Indústria e Construções	222,227.13	0.05
Nordon, Indústrias Metalúrgicas S/A	1,231,646.00	0.30
Procid, Participações e Negócios S/A	5,294,653.73	1.28
Ribeirão Preto Water Park S/A	416,786.85	0.10
Outros Investimentos de Renda Fixa	5,854,724.41	1.42
Precatórios	5,854,724.41	1.42
Valores a Pagar	(468,377.95)	(0.11)
Outros Investimentos de Renda Fixa	(468,377.95)	(0.11)
Total	33,539,642.43	8.12
Disponível		
Descrição	Valor	(%). s/Segmento
Disponível - Conta Corrente	45,308.99	0.01
Provisão para Perda		
Descrição	Valor Mercado	(%). s/Segmento
Certificado de Depósito Bancário	(8,392,239.42)	(2.03)
Banco Santos S/A	(8,392,239.42)	(2.03)
Debêntures não Conversíveis	(19,761,056.55)	(4.78)
Crefisul Leasing S/A, Arrendamento Mercantil	(2,478,003.90)	(0.60)
Encol S/A, Engenharia, Comercio e Indústria	(10,117,738.94)	(2.45)
Inepar S/A, Indústria e Construções	(222,227.13)	(0.05)
Nordon Indústrias Metalúrgicas S/A	(1,231,646.00)	(0.30)
Procid, Participações e Negócios S/A	(5,294,653.73)	(1.28)
Ribeirão Preto Water Park S/A	(416,786.85)	(0.10)
Total	(28,153,295.97)	(6.81)
TOTAL DO SEGMENTO DE RENDA FIXA	413,108,554.82	100.00

Composição do Segmento Renda Variável

Mercado à Vista			
Ações	Tipo	Valor Mercado (R\$)	(%). s/Segmento
Arcelor Brasil	(ON)	1,518,057.29	1.81
Bradesco	(PN)	7,588,434.00	9.02
Brasil T. Participações	(PN)	1,688,267.57	2.01
Brasil Telecom	(PN)	4,996,344.29	5.95
Braskem	(PNA)	967,200.00	1.15
Ccr Rodovias	(ON)	3,807,420.00	4.53
Cemig	(PN)	1,244,376.00	1.48
Cia. Siderúrgica Nacional	(ON)	2,183,040.00	2.60
Coteminas	(PN)	1,317,780.00	1.57
Ctm Citrus	(PN)	12,665.00	0.02
Gazeta Mercantil	(PN)	68,656.51	0.08
Gerdau	(PN)	1,565,120.00	1.86
Gol	(PN)	2,384,970.00	2.84
Itaubanco	(PN)	9,736,987.00	11.58
Marcopolo	(PN)	2,420,000.00	2.88
Natura	(ON)	703,725.00	0.84
Pão de Açúcar - CBD	(PN)	1,252,498.80	1.49
Petrobrás	(ON)	1,360,238.00	1.62
Petrobrás	(PN)	17,486,464.00	20.80
Randon Participações	(PN)	754,400.00	0.90
Ribeirão Preto Water Park	(ON)	0.00	0.00
Usiminas	(PNA)	1,748,340.00	2.08
Vale do Rio Doce	(PNA)	17,054,366.00	20.30
Total		81,859,349.46	97.41

Fundos de Renda Variável		
Fundo de Investimento em Participações	Valor Mercado	(%). s/Segmento
Brasil Private Equity	400,788.87	0.48
Total	400,788.87	0.48
Valores a Receber / Pagar		
Descrição	Valor	(%). s/Segmento
Valores a Receber	1,853,040.97	2.21
Valores a Pagar	0.00	0.00



- Fundação de Previdência Complementar dos Empregados ou Servidores da FINEP, do IPEA, do CNPq, do INPE e do INPA

Total		1,853,040.97	2.21
Provisões para Perda			
Ações	Tipo	Valor de Mercado	(%). s/Segmento
Ctm Citrus	(PN)	(12,665.00)	(0.02)
Gazeta Mercantil	(PN)	(68,656.51)	(0.08)
Ribeirão Preto Water Park	(ON)	0.00	0.00
Total		(81,321.51)	(0.10)
TOTAL DO SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL		84,031,857.79	100.00

Composição do Segmento Imóveis		
Grupo	Valor Mercado	(%). s/Segmento
Shopping Center's	8,923,558.96	65.19
Fundo de Investimento Imobiliário	2,704,282.57	19.75
Total	11,627,841.53	84.94
Valores a Receber / Pagar		
Descrição	Valor	(%). s/Segmento
Valores a Receber - Aluguel	66,079.07	0.48
Valores a Receber - Venda de Imóvel	1,995,405.74	14.58
Valores a Pagar	0.00	0.00
Total	2,061,484.81	15.06
TOTAL DO SEGMENTO DE IMÓVEIS	13,689,326.34	100.00

Composição do Segmento Empréstimos e Financiamentos			
Descrição	Tipo	Valor de Mercado	(%) . s/Segmento
Empréstimos	Pré-Fixado	46,953,209.05	97.79
Total		46,953,209.05	97.79
Valores a Receber / Pagar			
Descrição	Valor	(%). s/Segmento	
Valores a Receber	1,094,276.43	2.27	
Valores a Pagar	(31,158.58)	(0.06)	
Total	1,063,117.85	2.21	
TOTAL DO SEGMENTO DE EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS		48,016,326.90	100.00

Tabela Comparativa dos Limites de Alocação Definidos na Resolução CMN Nº. 3.121



- Fundação de Previdência Complementar dos Empregados ou Servidores da FINEP, do IPEA, do CNPq, do INPE e do INPA

Composição da Carteira	Limite Máximo Resolução nº. 3.121	Investimentos FIPECq
Renda Fixa		73.92%
Total do Segmento (Art. 16 - Inciso I)	100% dos Recursos	
Títulos Federais, Estaduais e Municipais refinanciados pelo Tes. Nacional (Art.16 - Inciso I)	100% dos Recursos	
Títulos Privados e Títulos Estaduais e Municipais de Baixo Risco de Crédito (Art.16 - Inciso II)	80% dos Recursos	
Derivativos de Renda Fixa com Garantia (Art.15 Inciso I)	80% dos Recursos	
Renda Variável		15.04%
Plano de Benefício Definido (Art. 25 - Inciso I)	50% dos Recursos	
Investimentos Imobiliários		2.45%
Total do Segmento (Art.34)	14% dos Recursos	
Fundos Imobiliários (Art.35 - Inciso II)	25% do Fundo	
Emprést. e Financiamentos		8.59%
Total do Segmento (Art.42)	15% do Segmento	

Tabela Comparativa dos Limites da Política de investimentos

Composição da Carteira	Investimentos (%)	Política de Invest. Limites (%)
Renda Fixa	73.92	60 - 80
Renda Variável	15.04	10 - 20
Investimentos Imobiliários	2.45	0 - 8
Empréstimos e Financiamentos	8.59	3 - 15

Gestão dos Investimentos

Gestão	Valor	(%)
Própria	558,846,065.85	100.00
Terceirizada	-	-

- Os valores são referentes ao último dia do 1º trimestre/06

Administrador Estatutário Responsável pelos Investimentos

Nome: Roberto Teixeira de Carvalho
CPF: 347.166.297-91
Cargo: Diretor de Aplicações Financeiras
E-mail:roberto@fipeccq.org.br