

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	Junho/2006		Junho/2005	
	Valor	(%)	Valor	(%)
Renda Fixa	425.943.260,71	74,68	343.141.393,21	72,36
Renda Variável	80.515.881,24	14,11	78.788.100,37	16,61
Imóveis	13.693.416,92	2,40	10.807.373,45	2,28
Empréstimos e Financiamentos	50.241.776,40	8,81	41.486.132,75	8,75
Total de Investimentos	570.394.335,27	100,00	474.222.999,78	100,00

Rentabilidade dos Segmentos (Modelo de Cotas)

Segmentos	Valor da Cota	Rentab.Trimestre(%)	Índice de Performance	
			Benchmark	Rentab.Trimestre(%)
Renda Fixa	238,292805	3,43	Taxa CDI CETIP	3,58
Renda Variável	401,849464	(2,80)	IBOVESPA Médio	(3,04)
Imóveis	202,034918	2,55	INPC + 6% a.a.	1,66
Empréstimos e Financiamentos	246,335886	3,16	INPC + 6% a.a.	1,66

Distribuição dos Investimentos por Planos

Planos	Valor	(%)
Plano de Previdência Complementar - PPC	509.759.151,82	89,37
Plano de Previdência Especial - PPE	22.576.303,49	3,96
Plano Administrativo	38.058.879,96	6,67
Total de Investimentos	570.394.335,27	100,00

Rentabilidade (Modelo de Cotas)

Planos de Benefícios	Rentab. Trimestre (%)	Meta Atuarial (%)
Plano de Previdência Complementar - PPC	2,28	1,66
Plano de Previdência Especial - PPE	2,28	1,66

* 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	58.984.292,49	13,85
Letras Financeiras do Tesouro - LFT	18.357.939,53	4,31
Letras do Tesouro Nacional - LTN	16.027.355,58	3,76
Títulos da Dívida Agrária - TDA	4.706.825,32	1,11
Créditos Securitizados do Tesouro Nacional - CTN	679.732,67	0,16
Total	98.756.145,59	23,19

Títulos Privados

Espécie	Valor Mercado	(%).s/Segmento
Certificados de Depósitos Bancários - CDB	41.221.815,21	9,68
Debêntures não Conversíveis - D/NC	15.528.986,83	3,64
Certificado de Compra/Venda a Termo de Energia - CTE	2.597.036,94	0,61
Total	59.347.838,98	13,93

Fundos de Renda Fixa

Fundos	Valor Mercado	(%). s/Segmento
Fundos de Investimento Financeiro - FIF	255.997.016,63	60,11
BRB Mercado	94.206.965,08	22,12
BNP Paribas Optimun DI	26.780.192,61	6,29
Insigna FIF Multimercado	68.744.721,47	16,14
Profix Institucional Multimercado	483.163,67	0,11
Proteq Fundo de Investimento Multimercado	18.008.884,10	4,23
Pactual Yield DI	47.773.089,70	11,22
Fundos de Investimento em Direito Creditório - FIDC	5.042.557,64	1,18
Bancoop I	2.599.761,19	0,61
Bonsucesso	1.964.771,46	0,46
Chemical	478.024,99	0,11
Total	261.039.574,27	61,29

Valores a Receber / Pagar

Descrição	Valor	(%). s/Segmento
Valores a Receber	36.373.825,87	8,54
Certificado de Depósito Bancário	8.708.170,24	2,04
Banco Santos S/A	8.708.170,24	2,04
Debêntures não Conversíveis	22.375.121,61	5,26
AES Sul Distribuidora Gaúcha Energia S/A	1.877.254,74	0,44
Crefisul Leasing S/A, Arrendamento Mercantil	2.579.291,48	0,61
Encol S/A, Engenharia, Comercio e Indústria	10.505.449,33	2,47
Inepar S/A, Indústria e Construções	233.068,96	0,05
Nordon, Indústrias Metalúrgicas S/A	1.265.428,82	0,30
Procid, Participações e Negócios S/A	5.497.841,43	1,29
Ribeirão Preto Water Park S/A	416.786,85	0,10
Outros Investimentos de Renda Fixa	5.290.534,02	1,24
Precatórios	5.290.534,02	1,24
Valores a Pagar	(423.242,72)	(0,10)
Outros Investimentos de Renda Fixa	(423.242,72)	(0,10)
Total	35.950.583,15	8,44

Disponível

Descrição	Valor	(%). s/Segmento
Disponível - Conta Corrente	55.155,83	0,01

Provisão para Perda

Descrição	Valor Mercado	(%). s/Segmento
Certificado de Depósito Bancário	(8.708.170,24)	(2,04)
Banco Santos S/A	(8.708.170,24)	(2,04)
Debêntures não Conversíveis	(20.497.866,87)	(4,82)
Crefisul Leasing S/A, Arrendamento Mercantil	(2.579.291,48)	(0,61)
Encol S/A, Engenharia, Comércio e Indústria	(10.505.449,33)	(2,47)
Inepar S/A, Indústria e Construções	(233.068,96)	(0,05)
Nordon Indústrias Metalúrgicas S/A	(1.265.428,82)	(0,30)
Procid, Participações e Negócios S/A	(5.497.841,43)	(1,29)
Ribeirão Preto Water Park S/A	(416.786,85)	(0,10)
Total	(29.206.037,11)	(6,86)
TOTAL DO SEGMENTO DE RENDA FIXA	425.943.260,71	100,00

Composição do Segmento Renda Variável

Mercado à Vista

Ações	Tipo	Valor Mercado (R\$)	(%). s/Segmento
ARCELOR BRASIL	(ON)	1.501.640,93	1,87
BRADESCO	(PN)	7.311.792,00	9,08
BRASIL T. PARTICIPAÇÕES	(PN)	1.529.587,69	1,90
BRASIL TELECOM	(PN)	4.423.581,48	5,49
BRASKEM	(PNA)	798.000,00	0,99
CCR RODOVIAS	(ON)	3.271.740,00	4,06
CEMIG	(PN)	1.181.124,00	1,47
CIA. SIDERÚRGICA NACIONAL	(ON)	2.242.560,00	2,79
COTEMINAS	(PN)	1.207.620,00	1,50
CTM CITRUS	(PN)	12.665,00	0,02
GAZETA MERCANTIL	(PN)	68.656,51	0,09
GERDAU	(PN)	1.561.920,00	1,94
GOL	(PN)	3.120.100,00	3,88
ITAUBANCO	(PN)	9.450.296,00	11,73
MARCOPOLO	(PN)	2.772.000,00	3,44
NATURA	(ON)	614.075,00	0,76
PÃO DE AÇÚCAR - CBD	(PN)	925.276,80	1,15
PETROBRÁS	(ON)	1.403.882,00	1,74
PETROBRÁS	(PN)	17.629.194,00	21,89
RANDON PARTICIPAÇÕES	(PN)	569.600,00	0,71
RIBEIRÃO PRETO WATER PARK	(ON)	0,00	0,00
USIMINAS	(PNA)	1.725.460,00	2,14
VALE DO RIO DOCE	(PNA)	16.164.876,00	20,08
Total		79.485.647,41	98,72

Fundos de Renda Variável

Fundo de Investimento em Participações	Valor Mercado	(%). s/Segmento
BRASIL PRIVATE EQUITY	211.212,11	0,26
Total	211.212,11	0,26

Valores a Receber / Pagar

Descrição	Valor	(%). s/Segmento
Valores a Receber	900.343,23	1,12
Valores a Pagar	0,00	0,00
Total	900.343,23	1,12

Provisões para Perda

Ações	Tipo	Valor de Mercado	(%). s/Segmento
CTM CITRUS	(PN)	(12.665,00)	(0,02)
GAZETA MERCANTIL	(PN)	(68.656,51)	(0,09)
RIBEIRÃO PRETO WATER PARK	(ON)	0,00	0,0
Total		(81.321,51)	(0,10)

TOTAL DO SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL

80.515.881,24

100,00

Composição do Segmento Imóveis

Grupo	Valor Mercado	(%). s/Segmento
Shopping Center's	8.868.199,71	64,76
Fundo de Investimento Imobiliário	2.689.185,99	19,64
Total	11.557.385,70	84,40

Valores a Receber / Pagar

Descrição	Valor	(%). s/Segmento
Valores a Receber - Aluguel	100.831,22	0,74
Valores a Receber - Venda de Imóvel	2.035.200,00	14,86
Valores a Pagar	0,00	0,00
Total	2.136.031,22	15,60

TOTAL DO SEGMENTO DE IMÓVEIS

13.693.416,92

100,00

Composição do Segmento Empréstimos e Financiamentos

Descrição	Tipo	Valor de Mercado	(%) . s/Segmento
Empréstimos	Pré-Fixado	49.134.241,21	97,80
Total		49.134.241,21	97,80

Valores a Receber / Pagar

Descrição	Valor	(%) . s/Segmento
Valores a Receber	1.120.071,77	2,22
Valores a Pagar	(12.536,58)	(0,02)
Total	1.107.535,19	2,20
TOTAL DO SEGMENTO DE EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	50.241.776,40	100,00

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

Composição da Carteira	Limite Máximo Resolução Nº 3.121	Investimentos FIPECq
Renda Fixa		74,68%
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		14,11%
Plano de Benefício Definido (Art. 25 - Inciso I)	50% dos Recursos	
Investimentos Imobiliários		2,40%
Total do Segmento (Art.34)	14% dos Recursos	
Fundos Imobiliários (Art.35 - Inciso II)	25% do Fundo	
Empréstimos e Financiamentos		8,81%
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	74,68	60 - 80
Renda Variável	14,11	10 - 20
Investimentos Imobiliários	2,40	0 - 8
Empréstimos e Financiamentos	8,81	3 - 15

Gestão dos Investimentos

Gestão	Valor	(%)
Própria	570.394.335,27	100,00
Terceirizada	-	-

- Os valores são referentes ao último dia do 2º trimestre/06

CUSTOS INCORRIDOS NAS ATIVIDADES RELACIONADAS COM A ADMINISTRAÇÃO DE INVESTIMENTOS - 1º Semestre de 2006

Em atendimento ao disposto no Art. 8º - Inciso I, do Regulamento anexo à Resolução CMN nº 3.121, de 25/09/03, do Conselho Monetário Nacional, estamos apresentando os custos incorridos com a administração dos recursos da Entidade.

Descrição	Valor
Pessoal e Encargos	1.163.925,63
Serviços de Terceiros	211.686,66
Despesas Gerais	299.581,75
Depreciação/Amortização	26.296,96
Corretagens Pagas	66.592,43
Total	1.768.083,43

Administrador Estatutário Responsável pelos Investimentos

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