

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 2002, apresentamos o DAIEA resumido e consolidado dos investimentos da FIPeCC.

Distribuição dos Investimentos por Segmento

Segmento	Setembro/2004		Setembro/2003	
	Valor	(%)	Valor	(%)
Renda Fixa	326.397.293,40	75,36	296.412.214,17	81,46
Renda Variável	63.772.378,01	14,72	37.762.224,94	10,38
Imóveis	10.550.105,49	2,44	10.760.959,79	2,96
Empréstimos e Financiamento	32.381.597,75	7,48	18.938.722,83	5,20
Total de Investimentos	433.101.374,65	100,00	363.874.121,73	100,00

Rentabilidade dos Segmentos (Modelo de Cotas)

Segmento	Valor da Cota	Rentab. Trimestre (%)	Benchmark	Rentab. Benchmark (%)
Renda Fixa	187,50115	4,39	Taxa CDI CETIP	3,86
Renda Variável	219,08174	12,94	IBOVESPA Média	11,43
Imóveis	119,47216	2,48	INPC + 6% a.a.	2,89
Empréstimos e Financiamento	184,61192	3,09	INPC + 6% a.a.	2,89

Distribuição dos Investimentos por Plano

Plano de Benefício Definido	Valor	(%)
Renda Fixa	326.397.293,40	75,36
Renda Variável	63.772.378,01	14,72
Imóveis	10.550.105,49	2,44
Empréstimos e Financiamentos	32.381.597,75	7,48
Total de Investimentos	433.101.374,65	100,00

Rentabilidade por Plano de Benefício (Modelo de Cotas)

Plano de Benefício Definido	Rentab. Trimestre (%)	Meta Atuarial (%)
Recursos Garant. das Reservas Técnicas, Fundos e Provisões	5,24*	2,89

*apurada pela cota contábil

Valor em Risco (VaR)

Segmento	Método	VaR	% VaR
Renda Fixa	Paramétrico	578.669,92	0,18%
Renda Variável	Paramétrico	4.525.838,55	7,32%

Composição do Segmento Renda Fixa

Títulos Públicos

Espécie	Valor Mercado	(%) s/ Segmento
Notas do Tesouro Nacional - NTN	20.006.419,67	6,14
Letras Financeiras do Tesouro - LFT	19.290.181,52	5,91
Títulos da Dívida Agrária - TDA	7.303.388,05	2,24
Créditos Securitizado do Tesouro Nacional - CTN	1.285.046,07	0,39
Total	47.885.035,31	14,68

Títulos Privados

Espécie	Valor Mercado	(%) s/ Segmento
Certificados de Depósitos Bancários - CDB	64.579.422,48	19,79
Debêntures Conversíveis - DC	3.640.615,47	1,12
Debêntures não Conversíveis - D/NC	40.766.391,90	12,49
Certificado de Compra/Venda a Termo de Energia - CTE	1.961.812,44	0,60
Total	110.948.242,29	34,00

Fundos de Renda Fixa

Fundos	Valor Mercado	(%). s/Segmento
Quotas de Fundos de Investimento Financeiro - FIF		
Autopan FIDC	1.625.867,15	0,50
Bradesco FIF Plus	1.461.247,78	0,45
BRB Mercado	77.031.120,19	23,60
BANCOOP FIDC	3.043.713,50	0,93
Chemical FIDC	499.454,31	0,15
INSIGNA	52.058.521,55	15,95
Santos Protecq	13.504.393,53	4,14
Santos Sam Fix Institucional	4.275.896,41	1,31
Unibanco Institucional RF	11.764.080,87	3,60
Total	165.264.295,29	50,63

Valores a Receber/Pagar

Descrição	Valor	(%). s/Segmento
Valores a Receber	19.609.750,40	6,01
Debêntures não Conversíveis	13.174.631,43	4,04
Crefisul Leasing S/A, Arrendamento Mercantil	1.872.783,44	0,57
Encol S/A Engenharia, Comercio e Indústria	7.760.506,99	2,38
Globo Cabo S/A	1.931.505,23	0,59
Inepar S/A, Comercio e Indústria	167.101,92	0,05
Nordon Indústrias Metalúrgicas S/A	1.025.947,00	0,32
Ribeirão Preto Water Park S/A	416.786,85	0,13
Outros Investimentos de Renda Fixa	6.435.118,97	1,97
Precatórios	6.435.118,97	1,97
Valores a Pagar	(566.457,38)	(0,18)
Outros Investimentos de Renda Fixa	(514.809,52)	(0,16)
Obrigações Fiscais	(51.647,86)	(0,02)
Total	19.043.293,02	5,83

Disponível

Descrição	Valor	(%). s/Segmento
Disponível - Conta Corrente	71.674,39	0,02

Provisão para Perda

Descrição	Valor	(%). s/Segmento
Debêntures Conversíveis	(3.640.615,47)	(1,11)
Globo Cabo S/A	(3.640.615,47)	(1,11)
Debêntures não Conversíveis	(13.174.631,43)	(4,05)
Crefisul Leasing S/A, Arrendamento Mercantil	(1.872.783,44)	(0,58)
Encol S/A Engenharia, Comercio e Indústria	(7.760.506,99)	(2,38)
Globo Cabo S/A	(1.931.505,23)	(0,60)
Inepar S/A Industria e Construções	(167.101,92)	(0,05)
Nordon Indústria Metalúrgicas S/A	(1.025.947,00)	(0,31)
Ribeirão Preto Water Park S/A	(416.786,85)	(0,13)
Total	(16.815.246,90)	(5,16)

TOTAL DO SEGMENTO DE RENDA FIXA	326.397.293,40	100,00
--	-----------------------	---------------

Composição do Segmento Renda Variável

Mercado à Vista

Ações	Tipo	Valor Mercado	(%) s/Segmento
AMBEV	(PN)	2.748.701,60	4,31
BRABESCO	(PN)	3.958.500,00	6,21
BRASIL T. PARTICIPAÇÕES	(PN)	2.005.627,33	3,15
BRASIL TELECOM	(PN)	3.731.902,34	5,85
BRASKEM	(PNA)	474.000,00	0,74
CAEMI	(PN)	1.274.000,00	2,00
CCR RODOVIAS	(ON)	4.775.554,00	7,49
CEMIG	(PN)	2.260.512,00	3,55
CIA. SIDERÚRGICA NACIONAL	(ON)	1.848.420,00	2,90
CIA. SIDERÚRGICA TUBARÃO	(PN)	1.032.070,00	1,62
CTM CITRUS	(PN)	12.665,00	0,02
GAZETA MERCANTIL	(PN)	68.656,51	0,11
GERDAU	(PN)	1.536.810,00	2,41
GOL	(PN)	375.830,00	0,59
ITAUBANCO	(PN)	5.276.526,03	8,27
ITAÚSA	(PN)	1.411.806,93	2,21
MARCOPOLO	(PN)	127.200,00	0,20
PÃO DE AÇÚCAR - CBD	(PN)	1.338.994,00	2,10
PETROBRÁS	(ON)	754.677,50	1,18
PETROBRAS	(PN)	5.415.990,72	8,49
SUZANO PAPEL	(PNA)	1.184.000,00	1,86
TELEMAR	(PN)	3.085.290,00	4,84
TELEMAR N L	(PNA)	3.514.426,00	5,51
TELESP	(PN)	1.167.097,00	1,83
TELESP CL PARTICIPAÇÕES	(PN)	281.600,00	0,44
UNIBANCO	(UNT)	205.050,00	0,32
VCP VOTORANTIM CELULOSE	(PN)	3.247.695,00	5,09
VALE DO RIO DOCE	(PNA)	8.719.920,00	13,67
Total		61.833.521,96	96,96

Fundo de Renda Variável

Fundo de Ações	Valor Mercado	(%) s/Segmento
BRASIL PRIVATE EQUITY	2.220.120,36	3,48
Total	2.220.120,36	3,48

Valores a Receber/Pagar

Descrição	Valor	(%) s/Segmento
Valores a Receber	1.099.664,66	1,72
Valores a Pagar	(1.299.607,46)	(2,03)
Total	(199.942,80)	(0,31)

Provisões para Perda

Ações	Tipo	Valor	(%) s/Segmento
CTM CITRUS	(PN)	(12.665,00)	(0,02)
GAZETA MERCANTIL	(PN)	(68.656,51)	(0,11)
Total		(81.321,51)	(0,13)

TOTAL DO SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL

63.772.378,01

100,00

Composição do Segmento Imóveis

Grupo	Valor Mercado	(%) s/Segmento
Edificações	2.537.976,75	24,06
Shopping Center's	5.538.282,70	52,50
Fundo de Investimento Imobiliário	2.397.550,60	22,72
Total	10.473.810,05	99,28

Valores a Receber/Pagar

Descrição	Valor Mercado	(%) s/Segmento
Valores a Receber	76.295,44	0,72
Valores a Pagar	0,00	0,00
Total	76.295,44	0,72

TOTAL DO SEGMENTO DE IMÓVEIS

10.550.105,49

100,00

Composição do Segmento Empréstimos e Financiamentos

Descrição	Tipo	Valor de Mercado	(%). s/ Segmento
Empréstimos	Pré-Fixado	31.623.637,17	97,66
Total		31.623.637,17	97,66

Valores a Receber/Pagar

Descrição	Valor	(%). s/ Segmento
Valores a Receber	762.152,22	2,35
Valores a Pagar	(4.191,64)	(0,01)
Total	757.960,58	2,34

TOTAL DO SEGMENTO DE EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	32.381.597,75	100,00
--	----------------------	---------------

Tabela Comparativa dos Limites de Alocação Definidos na Resolução CMN Nº. 3121

Composição da Carteira	Limite Máximo Resolução Nº 3121	Investimento FIPECq
Renda Fixa		75,36%
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		14,72%
Plano de Benefício Definido (Art. 25 - Inciso I)	45% dos Recursos	
Investimentos Imobiliários		2,44%
Total do Segmento (Art.34)	14% dos Recursos	
Alugueis e Renda (Art.35 - Inciso II)	70% do Segmento	
Emprést. e Financiamentos		7,48%
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	75,36%	78,57%
Renda Variável	14,72%	13,88%
Investimentos Imobiliários	2,44%	2,51%
Empréstimos e Financiamentos	7,48%	5,04%

Gestão dos Investimentos

Gestão	Valor	(%)
Própria	433.101.374,65	100,00%
Terceirizada	-	-

- Os valores são referentes ao último dia do 3º trimestre/04. Informamos que o relatório contém modificações após o envio do DAIEA à SPC/MPAS.

Custos Incurridos com a Administração de Investimentos - 3º Trimestre de 2004

Em atendimento ao disposto no Art. 8º - Inciso I, do Regulamento anexo à Resolução nº 2.829, de 30/03/2001, do Conselho Monetário Nacional estamos apresentando os custos incurridos, com a administração de recursos da Entidade.

Especificação	Valor
Gestão de Investimentos *	767.964,26
Consultoria	8.203,20
Custódia	9.899,77
Auditoria	3.534,00
Corretagens Pagas	23.381,47

* Foram incluídas as despesas com Pessoal e Encargos, Serviços de Terceiros, Despesas Gerais e outras Despesas Administrativas.

Administrador Estatutário Resp. pelos Investimentos

Nome: LUIZ FERNANDO DE ALMEIDA BELLO
 CPF: 406.550.247-00
 Cargo: Diretor de Aplicações Financeiras
 E-mail: bello@fipecq.org.br