

Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Unibanco Conversão 60

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) – CNPJ Nº 00.795.808/0001-02

| DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 (em milhares de reais) | | |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|-----------------|
| Aplicações/especificações | Valor atual | % sobre o ativo |
| TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | | |
| QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | | |
| Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Conversão nº 30..... | 49.963 | 99,97 |
| TOTAL DA CARTEIRA | 49.963 | 99,97 |
| DISPONIBILIDADES..... | 10 | 0,02 |
| DEVEDORES DIVERSOS..... | 4 | 0,01 |
| | 49.977 | 100,00 |
| EXIGIBILIDADES | | |
| VALORES A PAGAR | | |
| Provisão para pagamentos a efetuar..... | 8 | |
| Taxa de administração..... | 22 | |
| | 30 | |
| PATRIMÔNIO LÍQUIDO | | |
| Representado por 21.102.790 quotas de R\$ 2,3668..... | 49.947 | |
| | 49.977 | |

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

| DEMONSTRAÇÕES DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO EXERCÍCIOS FÍNDOS EM 31 DE MARÇO (em milhares de reais) | | | |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|---------------|--|
| | 2001 | 2000 | |
| Patrimônio líquido no início do exercício | | | |
| Representado por 24.434.351 quotas de R\$ 2,1462..... | 52.441 | 71.215 | |
| (2000 28.323.039 quotas de R\$ 1,8583)..... | | | |
| Quotas emitidas 4.528.692..... | 10.247 | | |
| Quotas resgatadas 7.860.253..... | (5.276) | | |
| (2000 13.888.688)..... | | (8.589) | |
| Varição no resgate de quotas..... | (12.553) | (19.133) | |
| Patrimônio líquido antes do resultado do exercício..... | 44.859 | 43.493 | |
| Resultado do exercício | | | |
| Receitas | | | |
| Rendas de títulos e valores mobiliários..... | 5.904 | 12.012 | |
| Despesas | | | |
| Taxa de administração..... | 799 | 3.050 | |
| Administrativas..... | 17 | 12 | |
| Outras..... | 816 | 2 | |
| | 816 | 3.064 | |
| Resultado do exercício apropriado a resultados acumulados..... | 5.088 | 8.948 | |
| Patrimônio líquido no final do exercício | | | |
| Representado por 21.102.790 quotas de R\$ 2,3668..... | | | |
| (2000 24.434.351 quotas de R\$ 2,1462)..... | 49.947 | 52.441 | |

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)**1. Contexto operacional**

O Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Unibanco Conversão 60 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 22 de setembro de 1995. Sua finalidade é aplicar os recursos captados, adquirindo quotas de fundos de investimento 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 no qual o fundo possui aplicações, conforme previsto no regulamento. As aplicações realizadas no Fundo não contam com garantia da instituição administradora ou do Fundo Garantidor de Créditos – FGC.

Em 29 de setembro de 2000 o fundo incorporou o Unibanco Conversão Renda Fixa 60 e o Unibanco Conversão 30. O patrimônio desses fundos montava R\$ 10,247 na data da incorporação e correspondeu à emissão de 4.528.592 novas quotas.

2. Principais práticas contábeis

As principais práticas contábeis adotadas para a contabilização das operações e para a elaboração das demonstrações financeiras decorrem das normas do Banco Central do Brasil.

As aplicações em quotas de fundos de investimento são demonstradas por seu valor de realização na data das demonstrações financeiras.

3. Emissão e resgate de quotas

As quotas do fundo têm seu valor calculado diariamente, com base em avaliação patrimonial que considera o valor de mercado dos ativos financeiros integrantes da carteira. Na emissão de quotas do fundo é utilizado o valor da quota em vigor no dia da efetiva disponibilidade dos recursos confiados pelo investidor ao administrador. As quotas são nominativas, intransferíveis e mantidas em conta de depósito em nome de seus titulares. No resgate é utilizado o valor da quota em vigor na data da solicitação.

3. Distribuição de resultados

Os resultados auferidos são incorporados ao patrimônio com a correspondente variação do valor das quotas, de maneira que todos os condôminos deles participem proporcionalmente à quantidade de quotas possuídas.

4. Taxa de administração

A taxa de administração prevista no estatuto do fundo é de até 5% ao ano, calculada diariamente sobre o patrimônio líquido e paga mensalmente.

5. Rentabilidade

A rentabilidade do fundo nos últimos exercícios foi a seguinte:

| Ano | Rentabilidade |
|-----------|---------------|
| 2001..... | 10,28% |
| 2000..... | 15,49% |
| 1999..... | 19,20% |
| 1998..... | 15,61% |
| 1997..... | 18,79% |

7. Quotas em carteira

O fundo de investimento financeiro no qual o fundo mantém aplicação é administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.
Edgar Bernardo dos Santos - Contador CRC 1SP154.129/O-7 - CPF 014.296.508-18

PARECER DOS AUDITORES INDEPENDENTES

27 de abril de 2001
Aos Administrador e Condôminos
Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Unibanco Conversão 60 (Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.)

1. Examinamos a demonstração da composição e diversificação das aplicações do Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Unibanco Conversão 60 em 31 de março de 2001 e as demonstrações da evolução do patrimônio líquido dos exercícios findos em 31 de março de 2001 e de 2000, elaboradas sob a responsabilidade da administração. Nossa responsabilidade é a de emitir parecer sobre essas demonstrações financeiras.

2. Nossos exames foram conduzidos de acordo com as normas de auditoria aplicáveis no Brasil que requerem que os exames sejam realizados com o objetivo de comprovar a adequada apresentação das demonstrações financeiras em todos os seus aspectos relevantes. Portanto, nossos exames compreenderam, entre outros procedimentos: (a) o planejamento dos trabalhos, considerando a relevância dos saldos, o volume de transações e os sistemas contábil e de controles internos do fundo, (b) a constatação, com base em testes, das evidências e dos registros que suportam os valores e as informações contábeis divulgados e (c) a avaliação das práticas e estimativas contábeis mais representativas adotadas pela administração do fundo, bem como da apresentação das demonstrações financeiras tomadas em conjunto.

3. Somos de parecer que as referidas demonstrações financeiras apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Unibanco Conversão 60 em 31 de março de 2001 e o resultado das operações e a evolução do patrimônio líquido dos exercícios findos em 31 de março de 2001 e de 2000, de acordo com princípios contábeis geralmente aceitos no Brasil.

PRICEWATERHOUSECOOPERSAuditores Independentes
CRC 2SP000160/O-5Ricardo Baldin
Sócio
Contador CRC 1SP110374/O-0**Fundo de Aplicação em Quotas de Fundo de Investimento Curto Prazo**

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) – CNPJ Nº 00.802.392/0001-02

| DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 (em milhares de reais) | | |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------|
| Aplicações/especificações | Valor atual | % sobre o ativo |
| TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | | |
| QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | | |
| Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Curto Prazo .. | 5.665 | 99,82 |
| TOTAL DA CARTEIRA | 5.665 | 99,82 |
| DISPONIBILIDADES..... | 10 | 0,18 |
| | 5.675 | 100,00 |
| EXIGIBILIDADES | | |
| VALORES A PAGAR | | |
| Provisão para pagamentos a efetuar..... | 5 | |
| Taxa de administração..... | 16 | |
| | 21 | |
| PATRIMÔNIO LÍQUIDO | | |
| Representado por 4.285.712 quotas de R\$ 1,3192..... | 5.654 | |
| | 5.675 | |

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

| DEMONSTRAÇÕES DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO EXERCÍCIOS FÍNDOS EM 31 DE MARÇO (em milhares de reais) | | | |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|--------------|--|
| | 2001 | 2000 | |
| Patrimônio líquido no início do exercício | | | |
| Representado por 7.312.188 quotas de R\$ 1,2789..... | 9.352 | 19.679 | |
| (2000 16.185.877 quotas de R\$ 1,2158)..... | | | |
| Quotas emitidas 14.142.199..... | 18.384 | 66.769 | |
| (2000 54.081.144)..... | | | |
| Quotas resgatadas 7.168.675..... | (21.968) | (76.965) | |
| (2000 62.954.833)..... | | (811) | |
| Varição no resgate de quotas..... | (371) | (811) | |
| Patrimônio líquido antes do resultado do exercício..... | 5.397 | 8.672 | |
| Resultado do exercício | | | |
| Receitas | | | |
| Rendas de títulos e valores mobiliários..... | 510 | 1.085 | |
| Outras..... | 510 | 1.088 | |
| Despesas | | | |
| Taxa de administração..... | 237 | 402 | |
| Administrativas..... | 16 | 6 | |
| | 253 | 408 | |
| Resultado do exercício apropriado a resultados acumulados..... | 257 | 680 | |
| Patrimônio líquido no final do exercício | | | |
| Representado por 4.285.712 quotas de R\$ 1,3192..... | | | |
| (2000 7.312.188 quotas de R\$ 1,2789)..... | 5.654 | 9.352 | |

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) | | | |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|
| 1. Contexto operacional | | | |
| O Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Curto Prazo foi constituído de acordo com a Resolução nº 2.183, do Conselho Monetário Nacional, e Circular nº 2.616, do Banco Central do Brasil, com a denominação de Fundo Unibanco de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Curto Prazo e iniciou suas operações em 29 de março de 1996. Em 26 de abril de 1999, o fundo passou a adotar a denominação atual. Sua finalidade é aplicar os recursos captados, adquirindo quotas de fundos de investimento 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 no qual o fundo possui aplicações, conforme previsto no regulamento. As aplicações realizadas no Fundo não contam com garantia da instituição administradora ou do Fundo Garantidor de Créditos – FGC.

2. Principais práticas contábeis

As principais práticas contábeis adotadas para a contabilização das operações e para a elaboração das demonstrações financeiras decorrem das normas do Banco Central do Brasil. As aplicações em quotas de fundos de investimento são demonstradas por seu valor de realização na data das demonstrações financeiras.

3. Emissão e resgate de quotas

As quotas do fundo têm seu valor calculado diariamente, com base em avaliação patrimonial que considera o valor de mercado dos ativos financeiros integrantes da carteira. Na emissão de quotas do fundo é utilizado o valor da quota em vigor no dia da efetiva disponibilidade dos recursos confiados pelo investidor ao administrador. As quotas são nominativas, intransferíveis e mantidas em conta de depósito em nome de seus titulares. No resgate é utilizado o valor da quota em vigor na data da solicitação.

4. Distribuição de resultados

Os resultados auferidos são incorporados ao patrimônio com a correspondente variação do valor das quotas, de maneira que todos os condôminos deles participem proporcionalmente à quantidade de quotas possuídas.

5. Taxa de administração

A taxa de administração prevista no estatuto do fundo é de até 3,0% ao ano, calculada diariamente sobre o patrimônio líquido e paga mensalmente.

6. Rentabilidade

A rentabilidade do fundo nos últimos exercícios foi a seguinte:

| Ano | Rentabilidade |
|-----------|---------------|
| 2001..... | 3,15% |
| 2000..... | 5,19% |
| 1999..... | 5,19% |
| 1998..... | 4,03% |
| 1997..... | 3,90% |

7. Quotas em carteira

O fundo de investimento financeiro no qual o fundo mantém aplicação é administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.
Edgar Bernardo dos Santos - Contador CRC 1SP154.129/O-7 - CPF 014.296.508-18

PARECER DOS AUDITORES INDEPENDENTES

27 de abril de 2001
Aos Administrador e Condôminos
Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Curto Prazo (Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.)

1. Examinamos a demonstração da composição e diversificação das aplicações do Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Curto Prazo em 31 de março de 2001 e as demonstrações da evolução do patrimônio líquido dos exercícios findos em 31 de março de 2001 e de 2000, elaboradas sob a responsabilidade da administração. Nossa responsabilidade é a de emitir parecer sobre essas demonstrações financeiras.

2. Nossos exames foram conduzidos de acordo com as normas de auditoria aplicáveis no Brasil que requerem que os exames sejam realizados com o objetivo de comprovar a adequada apresentação das demonstrações financeiras em todos os seus aspectos relevantes. Portanto, nossos exames compreenderam, entre outros procedimentos: (a) o planejamento dos trabalhos, considerando a relevância dos saldos, o volume de transações e os sistemas contábil e de controles internos do fundo, (b) a constatação, com base em testes, das evidências e dos registros que suportam os valores e as informações contábeis divulgados e (c) a avaliação das práticas e estimativas contábeis mais representativas adotadas pela administração do fundo, bem como da apresentação das demonstrações financeiras tomadas em conjunto.

3. Somos de parecer que as referidas demonstrações financeiras apresentam adequadamente, em todos os aspectos relevantes, a posição patrimonial e financeira do Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Curto Prazo em 31 de março de 2001 e o resultado das operações e a evolução do patrimônio líquido dos exercícios findos em 31 de março de 2001 e de 2000, de acordo com princípios contábeis geralmente aceitos no Brasil.

PRICEWATERHOUSECOOPERSAuditores Independentes
CRC 2SP000160/O-5Ricardo Baldin
Sócio
Contador CRC 1SP110374/O-0**Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento DI Bônus**

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) – CNPJ Nº 00.799.415/0001-77

| DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 (em milhares de reais) | | |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------------|
| Aplicações/especificações | Valor atual | % sobre o ativo |
| TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS | | |
| QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | | |
| Unibanco Fundo de Investimento Financeiro DI 2..... | 488.605 | 99,93 |
| TOTAL DA CARTEIRA | 488.605 | 99,93 |
| DISPONIBILIDADES..... | 10 | 0,07 |
| DEVEDORES DIVERSOS..... | 344 | 0,07 |
| | 488.959 | 100,00 |
| EXIGIBILIDADES | | |
| VALORES A PAGAR | | |
| Provisão para pagamentos a efetuar..... | 6 | |
| Taxa de administração..... | 1.730 | |
| | 1.736 | |
| PATRIMÔNIO LÍQUIDO | | |
| Representado por 194.990.631 quotas de R\$ 2,4987..... | 487.223 | |
| | 488.959 | |

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

| DEMONSTRAÇÕES DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO EXERCÍCIOS FÍNDOS EM 31 DE MARÇO (em milhares de reais) | | | |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|----------------|--|
| | 2001 | 2000 | |
| Patrimônio líquido no início do exercício | | | |
| Representado por 89.640.514 quotas de R\$ 2,2471..... | 201.429 | 228.287 | |
| (2000 117.516.431 quotas de R\$ 1,9426)..... | | | |
| Quotas emitidas 279.937.211..... | 667.838 | 333.063 | |
| (2000 160.451.631)..... | | | |
| Quotas resgatadas 174.587.094..... | (357.147) | (351.907) | |
| (2000 188.327.548)..... | | (351.907) | |
| Varição no resgate de quotas..... | (61.552) | (41.211) | |
| Patrimônio líquido antes do resultado do exercício..... | 450.568 | 168.209 | |
| Resultado do exercício | | | |
| Receitas | | | |
| Rendas de títulos e valores mobiliários..... | 51.243 | 44.035 | |
| Outras..... | 51.243 | 44.035 | |
| Despesas | | | |
| Taxa de administração..... | 14.529 | 10.406 | |
| Administrativas..... | 59 | 409 | |
| | 14.588 | 10.815 | |
| Resultado do exercício apropriado a resultados acumulados..... | 36.655 | 33.220 | |
| Patrimônio líquido no final do exercício | | | |
| Representado por 194.990.631 quotas de R\$ 2,4987..... | | | |
| (2000 89.640.514 quotas de R\$ 2,2471)..... | 487.223 | 201.429 | |

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) | | | |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|
| 1. Contexto operacional | | | |
| O Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento DI Bônus 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 anteriormente era denominada Fundo Unibanco de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento DI – 30. Sua finalidade é aplicar os recursos captados, adquirindo quotas de fundos de investimento 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 no qual o fundo possui aplicações, conforme previsto no regulamento. As aplicações realizadas no Fundo não contam com garantia da instituição administradora ou do Fundo Garantidor de Créditos – FGC.

2. Principais práticas contábeis

As principais práticas contábeis adotadas para a contabilização das operações e para a elaboração das demonstrações financeiras decorrem das normas do Banco Central do Brasil.

As aplicações em quotas de fundos de investimento são demonstradas por seu valor de realização na data das demonstrações financeiras.

3. Emissão e resgate de quotas

As quotas do fundo têm seu valor calculado diariamente, com base em avaliação patrimonial que considera o valor de mercado dos ativos financeiros integrantes da carteira. Na emissão de quotas do fundo é utilizado o valor da quota em vigor no dia da efetiva disponibilidade dos recursos confiados pelo investidor ao administrador. As quotas são nominativas, intransferíveis e mantidas em conta de depósito em nome de seus titulares. No resgate é utilizado o valor da quota em vigor na data da solicitação.

4. Distribuição de resultados

Os resultados auferidos são incorporados ao patrimônio com a correspondente variação do valor das quotas, de maneira que todos os condôminos deles participem proporcionalmente à quantidade de quotas possuídas.

5. Taxa de administração

A taxa de administração prevista no estatuto do fundo é de até 4,5% ao ano, calculada diariamente sobre o patrimônio líquido e paga mensalmente.

6. Rentabilidade

A rentabilidade do fundo nos últimos exercícios foi a seguinte:

| Ano | Rentabilidade |
|-----------|---------------|
| 2001..... | 11,20% |
| 2000..... | 15,67% |
| 1999..... | 22,62% |
| 1998..... | 17,86% |

7. Quotas em carteira

O fundo de investimento financeiro no qual o fundo mantém aplicação é administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.
Edgar Bernardo dos Santos - Contador CRC 1SP154.129/O-7 - CPF 014.296.508-18

PARECER DOS AUDITORES INDEPENDENTES

27 de abril de 2001
Aos Administrador e Condôminos
Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento DI Bônus (Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.)

1. Examinamos a demonstração da composição e diversificação das aplicações do Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento DI Bônus em 31 de março de 2001 e as demonstrações da evolução do patrimônio líquido dos exercícios findos em 31 de março de 2001 e de 2000, elaboradas sob a responsabilidade da administração. Nossa responsabilidade é a de emitir parecer sobre essas demonstrações financeiras.

2. Nossos exames foram conduzidos de acordo com as normas de auditoria aplicáveis no Brasil que requerem que os exames sejam realizados com o objetivo de comprovar a adequada apresentação das demonstrações financeiras em todos os seus aspectos relevantes. Portanto, nossos exames compreenderam, entre outros procedimentos: (a) o planejamento dos trabalhos, considerando a relevância dos saldos, o volume de transações e os sistemas contábil e de controles internos do fundo, (b) a constatação, com base em testes, das evidências e dos registros que suportam os valores e as informações contábeis divulgados e (c) a avaliação das práticas e estimativas contábeis mais representativas adotadas pela administração do fundo, bem como da apresentação das demonstr