

## Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private 11

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) – CNPJ Nº 03.573.825/0001-93

### DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 (em milhares de reais)

| Aplicações/especificações                                   | Valor atual   | % sobre o ativo |
|---|---------------|-----------------|
| <b>TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS</b>                        |               |                 |
| <b>QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO</b>                     |               |                 |
| Fundo de Investimento Financeiro Loan.....                  | 2.934         | 10,17           |
| Fundo de Investimento Financeiro Portfólio 60.....          | 5.812         | 20,15           |
| Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Renda Fixa 2..... | 20.093        | 69,68           |
| <b>TOTAL DA CARTEIRA.....</b>                               | <b>28.839</b> | <b>100,00</b>   |
| <b>EXIGIBILIDADES</b>                                       |               |                 |
| <b>VALORES A PAGAR</b>                                      |               |                 |
| Provisão para pagamentos a efetuar.....                     | 4             |                 |
| Taxa de administração.....                                  | 8             |                 |
| <b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO</b>                                   |               |                 |
| Representado por 24.000.422 quotas de R\$ 1,2011.....       | <b>28.827</b> |                 |
|   | <b>28.839</b> |                 |

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

### DEMONSTRAÇÕES DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO (em milhares de reais)

|  | Exercício findo em 31 de março de 2001 | Período de 24 de janeiro a 31 de março de 2000 |
|--|--|--|
| <b>Patrimônio líquido no início do exercício/período</b>   |  |  |
| Representado por 24.723.941.....quotas de R\$ 1,0346 (Constituição 24.888.100 quotas de R\$ 1,0007)..... | 25.578                                 | 24.905   |
| Quotas resgatadas 723.519 (2000 164.159).....  | (812)                                  | (167)  |
| Variação no resgate de quotas.....   |  |  |
| <b>Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/período.....</b>                                   | <b>24.766</b>                          | <b>24.737</b>                                  |

| Recursos   | 4.152         | 858           |
|--|---------------|---------------|
| Rendas de títulos e valores mobiliários.....   |               |               |
| <b>Despesas</b>  |               |               |
| Taxa de administração.....   | 81            | 14            |
| Administrativas.....   | 10            | 3             |
|  | 91            | 17            |
| <b>Resultado do exercício/período apropriado a resultados acumulados.....</b>                | <b>4.061</b>  | <b>841</b>    |
| <b>Patrimônio líquido no final do exercício/período</b>                                      |               |               |
| Representado por 24.000.422 quotas de R\$ 1,2011 (2000 24.723.941 quotas de R\$ 1,0346)..... | <b>28.827</b> | <b>25.578</b> |

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 Carteira Private 11 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 24 de janeiro de 2000. 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 na 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 o 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 1% ao ano, calculada diariamente sobre o patrimônio líquido e paga mensalmente.

**6. Rentabilidade**  
A rentabilidade do fundo no último exercício/período foi a seguinte:

| Ano       | Rentabilidade |
|-----------|---------------|
| 2001..... | 16,09%        |
| 2000..... | 3,39%         |

**7. Quotas em carteira**  
Os fundos de investimento financeiro nos quais o fundo mantém aplicações são administrados 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  
Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private 11 (Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.)  
1. Examinamos a demonstração da composição e diversificação das aplicações do Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private 11 em 31 de março de 2001 e as demonstrações da evolução do patrimônio líquido do exercício findo em 31 de março de 2001 e do período de 24 de janeiro a 31 de março de 2000, elaboradas sob a responsabilidade da sua 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 divulgadas 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 Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private 11 em 31 de março de 2001 e o resultado das operações e a evolução do patrimônio líquido do exercício findo em 31 de março de 2001 e do período de 24 de janeiro a 31 de março de 2000, de acordo com princípios contábeis geralmente aceitos no Brasil.

**PRICEWATERHOUSECOOPERS**  
Audítores Independentes  
CRC 2SP900160/O-5  
Ricardo Baldin Sócio Contador CRC 1SP110374/O-0

## Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private 12

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) – CNPJ Nº 03.573.819/0001-36

### DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 (em milhares de reais)

| Aplicações/especificações                                   | Valor atual   | % sobre o ativo |
|---|---------------|-----------------|
| <b>TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS</b>                        |               |                 |
| <b>QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO</b>                     |               |                 |
| Fundo de Investimento Financeiro Derivativos 60.....        | 1.063         | 3,77            |
| Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Mix.....          | 9.154         | 32,48           |
| Fundo de Investimento Financeiro Portfólio 60.....          | 5.025         | 17,83           |
| Fundo de Investimento Financeiro Private Moderado 60.....   | 6             | 0,02            |
| Unibanco Fundo de Investimento Financeiro DI 3.....         | 2.908         | 10,32           |
| Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Renda Fixa 2..... | 10.030        | 35,58           |
| <b>TOTAL DA CARTEIRA.....</b>                               | <b>28.186</b> | <b>100,00</b>   |
| <b>EXIGIBILIDADES</b>                                       |               |                 |
| <b>VALORES A PAGAR</b>                                      |               |                 |
| Provisão para pagamentos a efetuar.....                     | 4             |                 |
| Taxa de administração.....                                  | 8             |                 |
| <b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO</b>                                   |               |                 |
| Representado por 24.137.979 quotas de R\$ 1,1672.....       | <b>28.174</b> |                 |
|   | <b>28.186</b> |                 |

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

### DEMONSTRAÇÕES DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO (em milhares de reais)

|   | Exercício findo em 31 de março de 2001 | Período de 24 de janeiro a 31 de março de 2000 |
|---|--|--|
| <b>Patrimônio líquido no início do exercício/período</b>  |  |  |
| Representado por 24.723.946 quotas de R\$ 1,0346..... (Constituição 24.888.100 quotas de R\$ 1,0007)..... | 25.579                                 | 24.905   |
| Quotas resgatadas 585.967 (2000 164.154).....   | (649)                                  | (167)  |
| Variação no resgate de quotas.....  |  |  |
| <b>Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/período.....</b>                                    | <b>24.930</b>                          | <b>24.737</b>                                  |

| Recursos   | 3.336         | 859           |
|--|---------------|---------------|
| Rendas de títulos e valores mobiliários.....   |               |               |
| <b>Despesas</b>  |               |               |
| Taxa de administração.....   | 81            | 14            |
| Administrativas.....   | 11            | 3             |
|  | 92            | 17            |
| <b>Resultado do exercício/período apropriado a resultados acumulados.....</b>                | <b>3.244</b>  | <b>842</b>    |
| <b>Patrimônio líquido no final do exercício/período</b>                                      |               |               |
| Representado por 24.137.979 quotas de R\$ 1,1672 (2000 24.723.946 quotas de R\$ 1,0346)..... | <b>28.174</b> | <b>25.579</b> |

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 2000 (em milhares de reais)

**1. Contexto operacional**  
O Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private 12 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 24 de janeiro de 2000 com a denominação de Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Carteira Corporativa 8. 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 na 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 primeiro dia útil subsequente ao 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 o 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 1,0% ao ano, calculada diariamente sobre o patrimônio líquido e paga mensalmente.

**6. Rentabilidade**  
A rentabilidade do fundo no último exercício/período foi a seguinte:

| Ano       | Rentabilidade |
|-----------|---------------|
| 2001..... | 12,82%        |
| 2000..... | 3,39%         |

**7. Quotas em carteira**  
Os fundos de investimento financeiro nos quais o fundo mantém aplicações são administrados 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  
Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private 12 (Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.)  
1. Examinamos a demonstração da composição e diversificação das aplicações do Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private 12 em 31 de março de 2001 e as demonstrações da evolução do patrimônio líquido do exercício findo em 31 de março de 2001 e do período de 24 de janeiro a 31 de março de 2000, elaboradas sob a responsabilidade da sua 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 divulgadas 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 Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private 12 em 31 de março de 2001 e o resultado das operações e a evolução do patrimônio líquido do exercício findo em 31 de março de 2001 e do período de 24 de janeiro a 31 de março de 2000, de acordo com princípios contábeis geralmente aceitos no Brasil.

**PRICEWATERHOUSECOOPERS**  
Audítores Independentes  
CRC 2SP900160/O-5  
Ricardo Baldin Sócio Contador CRC 1SP110374/O-0

## Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Carteira Corporativa 10

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) – CNPJ Nº 03.573.905/0001-49

### DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 (em milhares de reais)

| Aplicações/especificações                             | Valor atual   | % sobre o ativo |
|---|---------------|-----------------|
| <b>TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS</b>                  |               |                 |
| <b>QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO</b>               |               |                 |
| Fundo de Investimento Financeiro Trust.....           | 12.607        | 100,00          |
| <b>TOTAL DA CARTEIRA.....</b>                         | <b>12.607</b> | <b>100,00</b>   |
| <b>EXIGIBILIDADES</b>                                 |               |                 |
| <b>VALORES A PAGAR</b>                                |               |                 |
| Provisão para pagamentos a efetuar.....               | 4             |                 |
| Taxa de administração.....                            | 3             |                 |
|   | 7             |                 |
| <b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO</b>                             |               |                 |
| Representado por 10.579.315 quotas de R\$ 1,1910..... | <b>12.600</b> |                 |
|   | <b>12.607</b> |                 |

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

### DEMONSTRAÇÕES DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO (em milhares de reais)

|  | Exercício findo em 31 de março de 2001 | Período de 3 de fevereiro a 31 de março de 2000 |
|--|--|---|
| <b>Patrimônio líquido no início do exercício/período</b>   |  |   |
| Representado por 10.114.705 quotas de R\$ 1,0268..... (2000 3.000.000 quotas de R\$ 1,0000)..... | 10.386                                 | 3.000   |
| Quotas emitidas 4.870.293 (2000 7.164.997).....  | 5.458                                  | 7.180   |
| Quotas resgatadas 4.405.683 (2000 50.292).....   | (4.123)                                | (1)   |
| Variação no resgate de quotas.....   | (772)                                  | (50)  |
| <b>Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/período.....</b>                           | <b>10.949</b>                          | <b>10.129</b>                                   |

| Recursos   | 1.697         | 262           |
|--|---------------|---------------|
| Rendas de títulos e valores mobiliários.....   |               |               |
| <b>Despesas</b>  |               |               |
| Taxa de administração.....   | 33            | 4             |
| Administrativas.....   | 13            | 1             |
|  | 46            | 5             |
| <b>Resultado do exercício/período apropriado a resultados acumulados.....</b>                | <b>1.651</b>  | <b>257</b>    |
| <b>Patrimônio líquido no final do exercício/período</b>                                      |               |               |
| Representado por 10.579.315 quotas de R\$ 1,1910 (2000 10.114.705 quotas de R\$ 1,0268)..... | <b>12.600</b> | <b>10.386</b> |

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 Carteira Corporativa 10 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 3 de fevereiro de 2000. 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 na 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 o 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 1% ao ano, calculada diariamente sobre o patrimônio líquido e paga mensalmente.

**6. Rentabilidade**  
A rentabilidade do fundo no exercício foi de 15,99% (período 2000 - 2,68%).

**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  
Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Carteira Corporativa 10 (Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.)  
1. Examinamos a demonstração da composição e diversificação das aplicações do Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Carteira Corporativa 10 em 31 de março de 2001 e as demonstrações da evolução do patrimônio líquido do exercício findo em 31 de março de 2001 e do período de 3 de fevereiro a 31 de março de 2000, elaboradas sob a responsabilidade da sua 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 divulgadas 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 Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Carteira Corporativa 10 em 31 de março de 2001 e o resultado das operações e a evolução do patrimônio líquido do exercício findo em 31 de março de 2001 e do período de 3 de fevereiro a 31 de março de 2000, de acordo com princípios contábeis geralmente aceitos no Brasil.

**PRICEWATERHOUSECOOPERS**  
Audítores Independentes  
CRC 2SP900160/O-5  
Ricardo Baldin Sócio Contador CRC 1SP110374/O-0

## Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Carteira Institucional 10

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) – CNPJ Nº 03.573.882/0001-72

### DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2001 (em milhares de reais)

| Aplicações/especificações                                    | Valor atual    | % sobre o ativo |
|--|----------------|-----------------|
| <b>TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS</b>                         |                |                 |
| <b>QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO</b>                      |                |                 |
| Fundo de Investimento Financeiro Unibanco DI Corporate.....  | 168            | 0,15            |
| Fundo de Investimento Financeiro Previdência Renda Fixa..... | 109.564        | 99,85           |
| <b>TOTAL DA CARTEIRA.....</b>                                | <b>109.732</b> | <b>100,00</b>   |
| <b>EXIGIBILIDADES</b>  |                |                 |
| <b>VALORES A PAGAR</b>                                       |                |                 |
| Provisão para pagamentos a efetuar.....                      | 5              |                 |
| Taxa de Administração.....                                   | 9              |                 |
|  | 14             |                 |
| <b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO</b>                                    |                |                 |
| Representado por 92.365.018 quotas de R\$ 1,1879.....        | <b>109.718</b> |                 |
|  | <b>109.732</b> |                 |

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

### DEMONSTRAÇÕES DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO (em milhares de reais)

|   | Exercício findo em 31 de março de 2001 | Período de 17 de fevereiro de 1999 a 31 de março de 2000 |
|---|--|--|
| <b>Patrimônio líquido no início do exercício/período</b>  |  |  |
| Representado por 48.023.623 quotas de R\$ 1,0216..... (Constituição 18.892.000 quotas de R\$ 1,0000)..... | 49.063                                 | 18.892   |
| Quotas emitidas 161.192.018 (2000 46.630.632).....  | 175.050                                | 47.090   |
| Quotas resgatadas 116.850.623 (2000 17.499.009).....  | (118.098)                              | (17.550)   |
| Variação no resgate de quotas.....  | (8.079)                                | (149)  |
| <b>Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/período.....</b>                                    | <b>97.936</b>                          | <b>48.283</b>  |

| Recursos  | 11.862        | 780        |
|---|---------------|------------|
| Rendas de títulos e valores mobiliários.....                                  |               |            |
| <b>Despesas</b>   |               |            |
| Taxa de administração.....  | 67            |            |
| Administrativas.....  | 13            |            |
|   | 80            |            |
| <b>Resultado do exercício/período apropriado a resultados acumulados.....</b> | <b>11.782</b> | <b>780</b> |
| <b>Patrimônio líquido no final do exercício/período</b>                       |               |            |