

Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private Arrojado

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) – CNPJ Nº 02.850.179/0001-00

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		
Fundo de Investimento Financeiro Derivativos.....	18.931	99,98
TOTAL DA CARTEIRA	18.931	99,98
DISPONIBILIDADES	3	0,02
TOTAL	18.934	100,00

EXIGIBILIDADES		
VALORES A PAGAR		
Provisão para pagamentos a efetuar.....	4	
Taxa de administração.....	14	
TOTAL	18	
PATRIMÔNIO LÍQUIDO		
Representado por 13.715.574 quotas de R\$ 1,3792.....	18.916	
TOTAL	18.934	

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 09 de abril de 1999 a 31 de março de 2000		
			Ano	Rentabilidade
Patrimônio líquido no início do exercício/periodo				
Representado por 12.936.366 quotas de R\$ 1,2290.....	15.899			
(Constituição 75.000 quotas de R\$ 1,0000).....			75	
Quotas emitidas 13.634.177.....	17.755			
(2000 16.178.901).....		18.441		
Quotas resgatadas 12.854.969.....	(15.218)			
(2000 3.317.533).....		(3.435)		
Variação no resgate de quotas.....	(1.557)	(386)		
Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/ período	16.879	14.695		
Resultado do exercício/periodo				
Receitas				
Rendas de títulos e valores mobiliários.....	2.279	1.298		
Despesas				
Taxa de administração.....	224	89		
Administrativas.....	18	5		
TOTAL	242	94		
Resultado do exercício/periodo apropriado a resultados acumulados	2.037	1.204		
Patrimônio líquido no final do exercício/periodo				
Representado por 13.715.574 quotas de R\$ 1,3792.....	18.916			
(2000 12.936.366 quotas de R\$ 1,2290).....		15.899		

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 Private Arrojado 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 9 de abril de 1999. 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.

Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Institucional Uno

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) – CNPJ Nº 02.850.892/0001-45

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		
Fundo de Investimento Financeiro Estratégico.....	7.141	21,05
Unibanco Fundo de Investimento Institucional Portfólio 1.....	3.047	8,98
Fundo de Investimento Financeiro Institucional Portfólio 2.....	3.040	8,96
Unibanco Fundo de Investimento Financeiro DI 3.....	20.697	61,01
TOTAL DA CARTEIRA	33.925	100,00

EXIGIBILIDADES		
VALORES A PAGAR		
Provisão para pagamentos a efetuar.....	4	
Taxa de administração.....	10	
PATRIMÔNIO LÍQUIDO		
Representado por 251.493 quotas de R\$ 134,8540.....	33.915	
TOTAL	33.925	

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 4 de junho de 1999 a 31 de março de 2000		
			Ano	Rentabilidade
Patrimônio líquido no início do exercício/periodo				
Saldo inicial 251.493 quotas de R\$ 115,9873.....	29.170			
(Constituição 33.603 quotas de R\$ 100,0000).....		3.360		
Quotas emitidas.....		22.013		
(2000 219.261).....			(1)	
Quotas resgatadas.....		(140)		
(2000 1.371).....				
Variação no resgate de quotas.....				
Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/periodo	29.170	25.232		
Resultado do exercício/periodo				
Receitas				
Rendas de títulos e valores mobiliários.....	4.839	3.996		
Despesas				
Taxa de administração.....	82	55		
Administrativas.....	12	3		
TOTAL	94	58		
Resultado do exercício/periodo apropriado a resultados acumulados	4.745	3.938		
Patrimônio líquido no final do exercício/periodo				
Representado por 251.493 quotas de R\$ 134,8540.....	33.915			
(2000 251.493 quotas de R\$ 115,9873).....		29.170		

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 Institucional Uno 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 4 de junho de 1999. 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

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 no primeiro dia útil subsequente da data de 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 1% ao ano, calculada diariamente sobre o patrimônio líquido e paga mensalmente.

O fundo paga ao administrador taxa de performance correspondente a 25% da rentabilidade líquida diária do fundo que exceder 100% da variação do Certificado de Depósito Interfinanceiro - CDI (CETIP Extragrupo).

6. Rentabilidade

A rentabilidade do fundo no último exercício/período foi a seguinte:

Ano	Rentabilidade
2001.....	12,22%
2000.....	22,90%

7. Quotas em carteira

O fundo de investimento financeiro na 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 Private Arrojado (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 Private Arrojado em 31 de março de 2001 e as demonstrações de evolução do patrimônio líquido do exercício findo nesse data e do período de 09 de abril de 1999 a 31 de março de 2000, elaboradas sob a responsabilidade da sua administração. Nossa responsabilidade é 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 Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private Arrojado em 31 de março de 2001 e o resultado das operações e a evolução do patrimônio líquido do exercício findo nesse data e do período de 09 de abril de 1999 a 31 de março de 2000, de acordo com princípios contábeis geralmente aceitos no Brasil.

PRICEWATERHOUSECOOPERS Ricardo Baldin
Auditor Independente Sócio
CRC 2SP000160/O-5 Contador CRC 1SP110374/O-0

Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Universal “H”

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) – CNPJ Nº 02.850.869/0001-50

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		
Fundo de Investimento Financeiro Loan.....	457	4,45
Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Private Moderado.....	7.565	73,66
Unibanco Fundo de Investimento Financeiro DI 3.....	1.704	16,59
Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Renda Fixa 2.....	544	5,30
TOTAL DA CARTEIRA	10.270	100,00

EXIGIBILIDADES		
VALORES A PAGAR		
Provisão para pagamentos a efetuar.....	4	
Taxa de administração.....	6	
TOTAL	10	
PATRIMÔNIO LÍQUIDO		
Representado por 7.431.307 quotas de R\$ 1,3807.....	10.260	
TOTAL	10.270	

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 29 de abril de 1999 a 31 de março de 2000		
			Ano	Rentabilidade
Patrimônio líquido no início do exercício/periodo				
Representado por 7.637.707 quotas de R\$ 1,2031.....	9.189			
(Constituição 4.000.000 quotas de R\$ 1,0000).....		4.000		
Quotas emitidas.....		4.170		
(2000 3.860.703).....			(1)	
Quotas resgatadas 206.400.....		(248)		
(2000 222.996).....				
Variação no resgate de quotas.....	(268)			
Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/periodo	8.921	7.921		
Resultado do exercício/periodo				
Receitas				
Rendas de títulos e valores mobiliários.....	1.406	1.312		
Despesas				
Taxa de administração.....	58	39		
Administrativas.....	67	44		
Resultado do exercício/periodo apropriado a resultados acumulados	1.339	1.268		
Patrimônio líquido no final do exercício/periodo				
Representado por 7.431.307 quotas de R\$ 1,3807.....	10.260			
(2000 7.637.707 quotas de R\$ 1,2031).....		9.189		

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 Universal “H” 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 29 de abril de 1999. Sua finalidade é aplicar os recursos captados, adquirindo quotas de fundos de

Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Universal “I”

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) – CNPJ Nº 02.850.835/0001-66

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 Derivativos.....	701	2,53
Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Mix.....	1.802	6,51
Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Private Moderado.....	18.290	66,05
Unibanco Fundo de Investimento Financeiro DI 3.....	4.126	14,90
Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Renda Fixa 2.....	2.772	10,01
TOTAL DA CARTEIRA	27.691	100,00

EXIGIBILIDADES		
VALORES A PAGAR		
Provisão para pagamentos a efetuar.....	5	
Taxa de administração.....	12	
TOTAL	17	
PATRIMÔNIO LÍQUIDO		
Representado por 21.119.008 quotas de R\$ 1,3104.....	27.674	
TOTAL	27.691	

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 23 de junho de 1999 a 31 de março de 2000		
			Ano	Rentabilidade
Patrimônio líquido no início do exercício/periodo				
Representado por 21.054.990 quotas de R\$ 1,1485.....	24.181			
(Constituição 1.023.042 quotas de R\$ 1,0000).....		1.023		
Quotas emitidas 792.761.....	978			
(2000 20.530.339).....		21.241		
Quotas resgatadas 728.743.....	(167)		(5)	
(2000 498.391).....		(492)		
Variação no resgate de quotas.....	(700)			
Patrimônio líquido antes do resultado do exercício/ período	24.292	21.721		
Resultado do exercício/periodo				
Receitas				
Rendas de títulos e valores mobiliários.....	3.640	2.532		
Despesas				
Resultado transações títulos e valores mobiliários.....	115	70		
Taxa de administração.....	128	70		
Administrativas.....	15	2		
TOTAL	258	72		
Resultado do exercício/periodo apropriado a resultados acumulados	3.382	2.460		
Patrimônio líquido no final do exercício/periodo				
Representado por 21.119.008 quotas de R\$ 1,3104.....	27.674			
(2000 21.054.990 quotas de R\$ 1,1485).....		24.181		

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 Universal “I” 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 23 de junho de 1999. Sua finalidade é aplicar os recursos captados, adquirindo quotas de fundos de investimento financeiro. Os investidores podem

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.