

# Resumo do DAIEA - Demonstrativo Analítico de Investimentos e Enquadramento das Aplicações

## Plano VCNE - 12/2008

Entidade: Fundação Sen. José Ermírio de Moraes Período: 2008 CNPJ: 74.060.534/0001-40

### Responsáveis

Nome	Tipo	Tel.	E-Mail
Paulo Roberto Pisauro		11 3224 7318	paulo.pisauro@aluminocioba.com.br

### Distribuição dos Investimentos por Segmento

Segmento	dezembro 2007		dezembro 2008	
	Valor	Percentual	Valor	Percentual
Renda Fixa	57.492.876,27	99,70%	66.759.920,06	99,11%
Empréstimos e Financiamentos	174.535,19	0,30%	597.693,40	0,89%
<b>Total de Investimentos</b>	<b>57.667.411,46</b>		<b>67.357.613,46</b>	

### Rentabilidade dos Segmentos no Semestre (Modelo de Cotas)

Segmento / Benchmark	Valor da Cota	Rentabilidade
Renda Fixa	306,68	5,68
Taxa CDI CETIP		12,38
Empréstimos e Financiamentos	417,01	16,70

### Distribuição dos Investimentos - Gestão Terceirizada

Gestor	Valor	Percentual
BNP PARIBAS	4.889.360,14	7,26%
BRADESCO	13.164.004,81	19,54%
ITAU	19.329.207,81	28,70%
UNIBANCO	7.517.553,15	11,16%
VOTORANTIM	9.204.482,80	13,67%
<b>Total Gestão Terceirizada</b>	<b>54.104.608,71</b>	<b>80,33%</b>
<b>Total de Investimentos</b>	<b>67.357.613,46</b>	

### Composição de Renda Fixa

Espécie	Valor Mercado	Perc. s/ Segmento
<b>Títulos Privados</b>		
CDB indexado em taxa CDI	3.830.152,47	5,74%
Conta corrente	39.843,91	0,06%
Debênture indexada em taxa CDI	8.785.375,79	13,16%
<b>Total</b>	<b>12.655.372,16</b>	<b>18,96%</b>
<b>Fundos de Renda Fixa</b>		
ADRIÁTICO PREVIDENCIÁRIO MULTI - FIC DE FI	11.554.949,46	17,31%
ATLÂNTICO MULTIMERCADO FICFI	7.517.553,15	11,26%
BNP PARIBAS ÁRTICO FIC DE FI CONSERVADOR	2.996.715,60	4,49%
BNP PARIBAS ÁRTICO FICFI MULTIMERCADO	1.892.644,55	2,84%
BRADESCO FI MULT FUNSEJEM AGRESSIVO	5.090.646,15	7,63%
BRADESCO FI MULT FUNSEJEM CONSERVADOR	8.073.358,66	12,09%
FAC ÁGATA	9.204.482,80	13,79%
PACÍFICO PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO FICFI	7.774.196,42	11,65%
<b>Total</b>	<b>54.104.546,78</b>	<b>81,04%</b>
<b>Valores a pagar e receber</b>		
Valor a Pagar	0,00	0,00%
Valor a Pagar IRF	0,00	0,00%
Valor a Receber	1,12	0,00%
<b>Total</b>	<b>1,12</b>	<b>0,00%</b>
<b>Total do Segmento de Renda Fixa</b>	<b>66.759.920,06</b>	<b>100%</b>

### Empréstimos a Participantes

Espécie	Atrasados	Não Atrasados
CDI+	460,32	593.874,35
IGPD	3.358,71	0,02
<b>Total do Segmento de Empréstimos</b>	<b>3.819,03</b>	<b>593.874,37</b>

### Tabela Comparativa dos Limites de Alocação

Renda Fixa	Patrimônio	% Investimento	Limite Máximo
Carteira RF1 (Art. 9 - Incisos I e IX)	41.768.623,32	62,01	100% do PL Plano
Carteira RF1 (Art. 9 - Incisos II a IV, VI a VII e IX a XI e Art. 39 - In)	21.861.110,26	32,46	80% do PL Plano
Carteira RF2 (Art. 10 - Incisos I a VIII)	1.712.684,79	2,54	20% do PL Plano
<b>Total do Plano</b>	<b>65.342.418,37</b>	<b>97,01</b>	
Renda Variável	Patrimônio	% Investimento	Limite Máximo
Carteira RV 1 Novo Mercado	367.786,52	0,55	50% do PL Plano
Carteira RV 1 Nível 2	34.358,21	0,05	50% do PL Plano
Carteira RV 1 Nível 1	671.460,20	1,00	45% do PL Plano

Carteira RV 1 Outras Cias. e Derivativos (DVH e DVN)	393.440,55	0,58	35% do PL Plano
Carteira RV 2	0,00	0,00	20% do PL Plano
Carteira RV 3	0,00	0,00	3% do PL Plano
<b>Total do Plano</b>	<b>1.467.045,47</b>	<b>2,18</b>	
<b>Empréstimos e Financiamentos</b>	<b>Patrimônio</b>	<b>% Investimento</b>	<b>Limite Máximo</b>
Rentabilidade Empréstimo	597.693,40	0,88	15% do PL Plano
Financiamentos Imobiliários	0,00	0,00	10% do PL Plano
<b>Total do Plano</b>	<b>597.693,40</b>	<b>0,88</b>	
<b>Outros Valores</b>	<b>Patrimônio</b>	<b>% Investimento</b>	<b>Limite Máximo</b>
Pagar/Receber	-49.543,78	-0,07	
<b>Total do Plano</b>	<b>-49.543,78</b>	<b>-0,07</b>	
<b>Patrimônio Líquido</b>	<b>Patrimônio</b>	<b>% Investimento</b>	<b>Limite Máximo</b>
Patrimônio Líquido	67.357.613,46	0,00	
<b>Total do Plano</b>	<b>67.357.613,46</b>	<b>0,00</b>	

### Tabela Comparativa dos Limites da Política de Investimentos

Composição da Carteira	% Investimento	Limite Mínimo (%)	Limite Máximo (%)
Renda Fixa	99,11	50,00	100,00
Empréstimos e Financiamentos	0,89	0,00	15,00

### Custos Relacionados à Administração de Recursos

Descrição	Valores
Consultorias	1.563,57
Taxa de Custódia	550,66
Taxa Cetip	60,38
Taxa de Controladoria	955,24
<b>Total do Plano</b>	<b>3.129,85</b>