

DAIEA - Demonstrativo Analítico de Investimentos e Enquadramento das Aplicações				
Resumo aos Participantes				
Identificação				
Entidade:	Fundação Sen. José Ermírio de Moraes	Período:	1º Trimestre 2005	
Sigla:	FUNSEJEM	Código:	0291-2	CNPJ: 74.060.534/0001-40
Distribuição dos Investimentos por Segmento				
Segmento	março/2005		março/2004	
	Valor	Percentual	Valor	Percentual
Renda Fixa	181.119.489,16	99,79%	126.497.860,72	99,19%
Renda Variável	0,00	0,00%	5.347,91	0,00%
Imóveis	0,00	0,00%	0,00	0,00%
Empréstimos e Financiamentos	388.624,97	0,21%	1.032.727,38	0,81%
Total de Investimentos:	181.508.114,13		127.535.936,01	
Rentabilidade dos Segmentos (Modelo de Cotas)				
Segmento	Valor da Cota	Rentab. Trimestre	Benchmark	Rentab. Benchmark
Renda Fixa	189,2993	4,13%	Taxa CDI CETIP	4,18%
Empréstimos e Financiamentos	223,5023	4,78%		0,00%
Distribuição dos Investimentos por Plano				
Plano de Benefício	Valor		% / Total	
PLANO DE BENEFÍCIOS (VCNE)	28.887.452,88		15,92%	
Renda Fixa	28.825.710,04		15,88%	
Empréstimos e Financiamentos	61.742,84		0,03%	
Votorantim Prev	152.620.661,24		84,08%	
Renda Fixa	152.293.779,11		83,90%	
Empréstimos e Financiamentos	326.882,13		0,18%	
Total de Investimentos:	181.508.114,13			
Valores em Risco (VaR)				
Segmento	Método	VaR	% VaR	
Renda Fixa	Paramétrico	256.704,63	0,1421%	
Renda Variável	Paramétrico		%	
Distribuição dos Investimentos - Gestão Terceirizada				
Gestor	Valor	Percentual		
BRADESCO	24.860.821,52	13,70%		
CITIBANK	32.209.616,92	17,75%		
ITAU	37.680.923,61	20,76%		
VOTORANTIM	86.261.392,41	47,52%		
Total Gestão Terceirizada	181.012.754,47	99,73%		
Total de Investimentos	181.508.114,13			
Composição do Segmento Renda Fixa				
Títulos Privados				
Espécie	Valor Mercado	Perc. s/ Segmento		
Conta Corrente	113.313,93	0,06%		
Total	113.313,93	0,06%		
Fundos de Renda Fixa				
Fundo	Valor Mercado	Perc. s/ Segmento		
FAC AGATA	86.261.392,41	47,63%		
FAC ATLANTICO	24.860.821,52	13,73%		
FAC PACIFICO	37.680.923,61	20,80%		
INDICO FAQ FI	32.209.616,92	17,78%		
Total	181.012.754,47	99,94%		
Valores a Pagar e Receber				
Descrição	Valor	Perc. s/ Segmento		
Valor a Pagar	-6.579,24	0,00%		
Valor a Pagar IRF	0,00	0,00%		
Valor a Receber	0,00	0,00%		
Total	-6.579,24	0,00%		
Total Segmento de Renda Fixa	181.119.489,16			
Composição do Segmento Empréstimos e Financiamentos				
Empréstimos a Participantes				
Indexador	Atrasados	Não Atrasados		
IGPD	20.190,49	291.862,11		
IGPD	20.190,49	291.862,11		
Valores a Pagar e Receber				
Descrição	Atrasados	Não Atrasados		
Valor a Pagar	-	373,80		
Valor a Receber	-	76.946,17		
Total	-	76572,37		
Total do Segmento:	20.190,49	368.434,48		
Tabela Comparativa dos Limites da Política de Investimentos				
Composição da Carteira	% Investimento	Política		
		% Mínimo	% Máximo	
Renda Fixa	99,79%			
Renda Variável	0,00%			
Investimentos Imobiliário	0,00%			
Empréstimos e Financiamentos	0,21%			
Responsáveis				
Nome	Tipo	Tel.	E-Mail	
Paulo Roberto Pizauro	Administrador	11 3224 7318	paulo.pizauro@aluminiocba.com.br	