

Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Conversão N 30

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) - C.N.P.J. 00.793.576/0001-53

DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 30 DE JUNHO DE 1999 (em milhares de reais)

Aplicações/especificações	Valor atual	% sobre o ativo
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS		
Letras Financeiras do Tesouro - LFT	7.475	94,80
Notas do Tesouro Nacional - NTN	12	0,15
TOTAL DA CARTEIRA	7.487	94,95
DISPONIBILIDADES	1	0,01
CRÉDITOS VINCULADOS		
Banco Central do Brasil	397	5,04
	7.885	100,00
EXIGIBILIDADES		
VALORES A PAGAR		
Provisão para pagamentos a efetuar	2	
Taxa de administração	4	
	6	

PATRIMÔNIO LÍQUIDO		
Representado por 3.607.597 quotas de R\$ 2,1840	7.879	
	7.885	

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

DEMONSTRAÇÃO DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO EXERCÍCIOS FIMOS EM 30 DE JUNHO (em milhares de reais)

	1999	1998
Patrimônio líquido		
Saldo inicial: 6.482.169 quotas de R\$ 1,6959	10.993	
(1998: 12.382.264 quotas de R\$ 1,3671)		16.928
Quotas emitidas: (1998: 271.912)		449
Quotas resgatadas: 2.874.572	(3.367)	
(1998: 6.172.007)		(7.129)
Varição no resgate de quotas	(2.055)	(2.180)
Patrimônio líquido antes do resultado do exercício	5.571	8.068

Resultado do exercício		
Receitas		
Rendas de aplicações interfinanceiras de liquidez	519	2.208
Rendas de títulos e valores mobiliários	1.838	919
Outras	1	7
	2.358	3.134

Despesas		
Resultado em transações com títulos e valores mobiliários		132
Taxa de administração	46	69
Administrativas	4	8
	50	209
Resultado do exercício apropriado a resultados acumulados	2.308	2.925

Patrimônio líquido final		
Representado por: 3.607.597 quotas de R\$ 2,1840		
(1998: 6.482.169 quotas de R\$ 1,6959)	7.879	10.993

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

NOTAS EXPLICATIVAS DO ADMINISTRADOR ÀS DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS EM 30 DE JUNHO DE 1999 E DE 1998

1. Contexto operacional

O Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Conversão N 30 foi constituído de acordo com a Resolução nº 2.183, do Conselho Monetário Nacional, e Circular nº 2.616, do Banco Central do Brasil. Sua finalidade é possibilitar aos investidores a participação em uma carteira diversificada de ativos

financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado 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, prevista no regulamento do fundo. 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. Dentre essas práticas, destacam-se as seguintes:

- Os títulos e valores mobiliários são demonstrados ao custo de aquisição, acrescido dos rendimentos auferidos e, quando aplicável, ajustado ao valor de mercado. O ágio ou deságio na aquisição de títulos, se houver, é apropriado diariamente, em função do prazo de vigência dos títulos.
- Os créditos vinculados ao Banco Central do Brasil representam depósitos compulsórios e são demonstrados pelo seu valor de custo.

3. Distribuição de resultados

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

4. Taxa de Administração

A taxa de administração é calculada diariamente sobre o patrimônio líquido, à razão de 0,5% ao ano, e paga mensalmente.

5. Custódia dos títulos em carteira

Os ativos financeiros da carteira do fundo estão custodiados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia - SELIC. O fundo não incorreu em despesas com a custódia de títulos.

6. Rentabilidade

A rentabilidade do fundo nos últimos exercícios foi a seguinte:

Ano	Rentabilidade
1999	28,78%
1998	24,05%
1997	21,20%

7. Instrumentos financeiros

O fundo participa de operações envolvendo instrumentos financeiros derivativos com o intuito de reduzir sua exposição a riscos de mercado e de taxas de juros. Em 30 de junho de 1999 o fundo não possuía contratos de derivativos em aberto.

8. Outras informações

Em dezembro de 1998, o administrador do fundo entregou declaração de conformidade ao Banco Central do Brasil, relativa ao projeto que visa adequar seus equipamentos, sistemas e produtos eletrônicos para o correto processamento de datas posteriores ao ano 2000.

Edigar Bernardo dos Santos - Contador CRC 1SP154.129/O-7 - CPF 014.296.508-18

PARECER DOS AUDITORES INDEPENDENTES

6 de agosto de 1999

Aos Administradores e Condôminos

Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Conversão N 30

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.)

1. Examinamos a demonstração da composição e diversificação das aplicações do Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Conversão N 30 em 30 de junho de 1999 e as demonstrações da evolução do patrimônio líquido dos exercícios findos em 30 de junho de 1999 e de 1998, 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 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 Investimento Financeiro Conversão N 30 em 30 de junho de 1999 e o resultado das operações e a evolução do patrimônio líquido dos exercícios findos em 30 de junho de 1999 e de 1998, de acordo com princípios contábeis geralmente aceitos.

PRICEWATERHOUSECOOPERS 

Auditores Independentes
CRC 2SP000160/O-5

Ricardo Baldin
Sócio

Contador CRC 1SP110374/O-0