

Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Unibanco Conversão 60

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) - C.N.P.J. Nº 00.795.808/0001-02

DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2000 (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		
Conversão N 30.....	52.656	99,98
TOTAL DA CARTEIRA.....	52.656	99,98
DISPONIBILIDADES.....	10	0,02
	52.666	100,00

EXIGIBILIDADES		
VALORES A PAGAR		
Provisão para pagamentos a efetuar.....	2	
Taxa de administração.....	223	
	225	

PATRIMÔNIO LÍQUIDO		
Representado por 24.434.351 quotas de R\$ 2,1462.....	52.441	
	52.666	

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

DEMONSTRAÇÃO DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO EXERCÍCIOS FIMDOS EM 31 DE MARÇO (em milhares de reais)

	2000	1999
Patrimônio líquido		
Saldo inicial: 38.323.039 quotas de R\$ 1,8583.....	71.215	120.191
(1999: 77.094.811 quotas de R\$ 1,5590).....		
Quotas resgatadas: 13.888.688.....	(8.589)	(30.186)
(1999: 38.771.772).....		
Variação no resgate de quotas.....	(19.133)	(34.533)
Patrimônio líquido antes do resultado do exercício.....	43.493	55.472

Recursos do exercício		
Receitas		
Rendas de títulos e valores mobiliários.....	12.012	20.406
Outros.....	1	7
	12.012	20.407

Despesas		
Taxa de administração.....	3.050	4.649
Administrativas.....	12	15
Outras.....	2	
	3.064	4.664

Resultado do exercício apropriado a resultados acumulados.....	8.948	15.743
--	--------------	---------------

Patrimônio líquido final		
Representado por: 24.434.351 quotas de R\$ 2,1462 (1999: 38.323.039 quotas de R\$ 1,8583).....	52.441	71.215

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

NOTAS EXPLICATIVAS DO ADMINISTRADOR ÀS DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS EM 31 DE MARÇO DE 2000 E DE 1999

1. Contexto operacional

O Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Unibanco Conversão 60 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 22 de setembro de 1995. 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 e 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. A partir de 2 de agosto de 1999 o Fundo passou a possibilitar o resgate das quotas diariamente com a incorporação dos rendimentos, antes desta data o prazo de resgate de quotas com rendimento ocorria em intervalos de 60 dias, a contar da data da aplicação.

4. 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.

5. Taxa de Administração

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

6. Rentabilidade

A rentabilidade do fundo nos últimos exercícios foi a seguinte:

Ano	Rentabilidade
2000.....	15,49%
1999.....	19,20%
1998.....	15,61%
1997.....	18,79%

Edgar Bernardo dos Santos - Contador CRC ISP154.129/O-7 - CPF 014.296.508-18

PARECER DOS AUDITORES INDEPENDENTES

12 de maio de 2000

Aos Administrador e Condôminos
Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Unibanco Conversão 60 (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 Unibanco Conversão 60 em 31 de março de 2000 e as demonstrações da evolução do patrimônio líquido dos exercícios findos em 31 de março de 2000 e de 1999, 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 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 Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Unibanco Conversão 60 em 31 de março de 2000 e o resultado das operações e a evolução do patrimônio líquido dos exercícios findos em 31 de março de 2000 e de 1999, de acordo com princípios contábeis geralmente aceitos no Brasil.

PRICEWATERHOUSECOOPERS
Auditores Independentes
CRC 25P000160/O-5

Ricardo Baldin
Sócio
Contador CRC ISP110374/O-0

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

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) - C.N.P.J. Nº 02.850.963/0001-00

DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2000 (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 Private Moderado.....	168.952	99,82
TOTAL DA CARTEIRA.....	168.952	99,82
OUTROS CRÉDITOS.....	308	0,18
	169.260	100,00

EXIGIBILIDADES		
VALORES A PAGAR		
Provisão para pagamentos a efetuar.....	7	
Taxa de administração.....	121	
	128	

PATRIMÔNIO LÍQUIDO		
Representado por 139.779.112 quotas de R\$ 1,2100.....	169.132	
	169.260	

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

DEMONSTRAÇÃO DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO PERÍODO DE 9 DE ABRIL DE 1999 A 31 DE MARÇO DE 2000 (em milhares de reais)

Patrimônio líquido		
Constituição: 100.000 quotas de R\$ 1,0000.....	100	
Quotas emitidas: 189.694.253.....	215.841	
(53.891).....		
Quotas resgatadas: 50.015.141.....	(53.891)	
(3.975).....		
Variação no resgate de quotas.....	158.075	

Resultado do período		
Receitas		
Rendas de títulos e valores mobiliários.....	11.538	

Despesas		
Taxa de administração.....	464	
Administrativas.....	17	
	481	

Resultado do período apropriado a resultados acumulados.....	11.057	
--	---------------	--

Patrimônio líquido final		
Representado por: 139.779.112 quotas de R\$ 1,2100.....	169.132	

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

NOTAS EXPLICATIVAS DO ADMINISTRADOR ÀS DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS EM 31 DE MARÇO DE 2000

1. Contexto operacional

O Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private Moderado 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 e 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. A partir de 2 de agosto de 1999 o Fundo passou a possibilitar o resgate das quotas diariamente com a incorporação dos rendimentos, antes desta data o prazo de resgate de quotas com rendimento ocorria em intervalos de 60 dias, a contar da data da aplicação.

4. 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.

5. Taxa de Administração

A taxa de administração prevista no estatuto do fundo é de até 0,6% ao ano calculada diariamente sobre o patrimônio líquido, e paga mensalmente. O fundo paga ao administrador taxa de performance correspondente a 15% da rentabilidade líquida diária do fundo que exceder 100% da variação do Certificado de Depósito Interfinanceiro - CDI (CETIP Extra grupo).

6. Rentabilidade

A rentabilidade do fundo no período foi de 21,00%.

Edgar Bernardo dos Santos - Contador CRC ISP154.129/O-7 - CPF 014.296.508-18

PARECER DOS AUDITORES INDEPENDENTES

12 de maio de 2000

Aos Administrador e Condôminos
Unibanco Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private Moderado (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 Moderado em 31 de março de 2000 e a demonstração da evolução do patrimônio líquido do período de 9 de abril de 1999 a 31 de março de 2000, elaborados sob a responsabilidade da sua administração. Nossa responsabilidade é a de emitir parecer sobre essas demonstrações financeiras.

2. Nosso exame foi conduzido 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, nosso exame compreendeu, 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 Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private Moderado em 31 de março de 2000 e o resultado das operações e a evolução do patrimônio líquido do período de 09 de abril de 1999 a 31 de março de 2000, de acordo com princípios contábeis geralmente aceitos no Brasil.

PRICEWATERHOUSECOOPERS
Auditores Independentes
CRC 25P000160/O-5

Ricardo Baldin
Sócio
Contador CRC ISP110374/O-0

Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private 16

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) - C.N.P.J. Nº 03.639.112/0001-85

DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2000 (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 Renda Fixa.....	300	30,00
Unibanco Carteira Previdência - Fundo de Investimento Ações.....	100	10,00
Unibanco Fundo de Investimento Financeiro Private Moderado.....	500	50,00
Unibanco Private Bovespa Index - Fundo de Investimento em Ações.....	100	10,00
TOTAL DA CARTEIRA.....	1.000	100,00

EXIGIBILIDADES		
VALORES A PAGAR		
Provisão para pagamentos a efetuar.....	2	
Taxa de administração.....	218	
	220	

PATRIMÔNIO LÍQUIDO		
Representado por 1.000.000 quotas de R\$ 1,0003.....	1.000	
	1.000	

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

DEMONSTRAÇÃO DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO PERÍODO DE 30 A 31 DE MARÇO DE 2000 (em milhares de reais)

Patrimônio líquido		
Constituição: 1.000.000 quotas de R\$ 1,0000.....	1.000	
Patrimônio líquido antes do resultado do período.....	1.000	

Patrimônio líquido final		
Representado por: 1.000.000 quotas de R\$ 1,0003.....	1.000	

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

NOTAS EXPLICATIVAS DO ADMINISTRADOR ÀS DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS EM 31 DE MARÇO DE 2000

1. Contexto operacional

O Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Private 16 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 30 de março 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 e 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.

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.

A partir de 2 de agosto de 1999 o Fundo passou a possibilitar o resgate das quotas diariamente com a incorporação dos rendimentos, antes desta data o prazo de resgate de quotas com rendimento ocorria em intervalos de 60 dias, a contar da data da aplicação.

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.

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

A rentabilidade do fundo nos últimos exercícios foi a seguinte:

Ano	Rentabilidade
2000.....	15,49%
1999.....	19,20%
1998.....	15,61%
1997.....	18,79%

Edgar Bernardo dos Santos - Contador CRC ISP154.129/O-7 - CPF 014.296.508-18

Fundo de Aplicação em Quotas de Fundos de Investimento Carteira Institucional 6

(Administrado pelo Unibanco - União de Bancos Brasileiros S.A.) - C.N.P.J. Nº 03.389.701/0001-52

DEMONSTRAÇÃO DA COMPOSIÇÃO E DIVERSIFICAÇÃO DAS APLICAÇÕES EM 31 DE MARÇO DE 2000 (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 Cambial.....	4.786	100,00
TOTAL DA CARTEIRA.....	4.786	100,00

EXIGIBILIDADES		
VALORES A PAGAR		
Provisão para pagamentos a efetuar.....	4	
Taxa de administração.....	2	
	6	

PATRIMÔNIO LÍQUIDO		
Representado por 4.906.091 quotas de R\$ 0,9744.....	4.780	
	4.786	

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

DEMONSTRAÇÃO DA EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO LÍQUIDO - PERÍODO DE 29 DE OUTUBRO DE 1999 A 31 DE MARÇO DE 2000 (em milhares de reais)

Patrimônio líquido		
Constit		