

Resumo do DAIEA - GEIPREV

DAIEA -

Data Posição:

Demonstrativo Analítico de Investimento e Enquadramento de Aplicações
30/12/2005**Distribuição dos Investimentos por Segmento**

Segmento	dezembro/2005		dezembro/2004	
	Valor	Percentual	Valor	Percentual
Renda Fixa	49.579.305,35	46,51%	0,00	0,00%
Renda Variável	40.800.747,90	38,27%	0,00	0,00%
Imóveis	14.296.790,52	13,41%	0,00	0,00%
Empréstimos e Financiamentos	1.923.809,19	1,80%	0,00	0,00%
Total de Investimentos:	106.600.652,96		0,00	

Rentabilidade dos Segmentos (Modelo de Cotas)

Segmento	Valor da Cota	Rentab. Trimestre	Benchmark	Rentab. Benchmark
Renda Fixa	207,3794	4,28%	Taxa CDI CETIP	4,31%
Renda Variável	370,4438	3,93%	IBOVESPA MÉDIA	6,13%
Renda Variável	370,4438	3,93%	Índice IBX	7,96%
Imóveis	156,6995	0,88%		0,00%
Empréstimos e Financiamentos	169,0308	5,26%		0,00%

Distribuição dos Investimentos por Plano

Plano de Benefício	Valor	% / Total
Plano GEIPOT	106.600.652,96	100,00%
Renda Fixa	49.579.305,35	46,51%
Renda Variável	40.800.747,90	38,27%
Imóveis	14.296.790,52	13,41%
Empréstimos e Financiamentos	1.923.809,19	1,80%
Total de Investimentos:	106.600.652,96	

Composição do Segmento Renda Fixa

Títulos Públicos		
Espécie	Valor Mercado	Perc. s/ Segmento
TDA	9.358.849,07	18,87%
NTNC	6.736.546,33	13,59%
NTNB	5.724.165,82	11,55%
BTN_dol	3.140.779,51	6,33%
Total	24.958.340,73	50,34%

Títulos Privados		
Espécie	Valor Mercado	Perc. s/ Segmento
Conta Corrente	10.599,76	0,02%
Cédula de Crédito Bancária	1.696.550,30	3,42%
DEBENTURE indexada em taxa CDI	1.644.241,42	3,32%
DEBENTURE indexada em taxa IGP-M	11.606.251,49	23,41%
DEBENTURE indexada em taxa referencial (TR)	876.800,56	1,77%
LH indexada em taxa referencial (TR)	713.898,23	1,44%
Total	16.548.341,76	33,38%

Fundos de Renda Fixa		
Fundo	Valor Mercado	Perc. s/ Segmento
BNP PARIBAS OPTIMUM DI	4.043.722,90	8,16%
HSBC FIF DI INSTITUCIONAL	857.577,97	1,73%
HSBC FIF TIPO INSTITUCIONAL	2.783.389,49	5,61%
MULTI BRÁSILIA III	6.658.354,32	13,43%
PROFIX INSTITUCIONAL FIF MULTI	445.466,93	0,90%
Total	14.788.511,61	29,83%

Valores a Pagar e Receber		
Descrição	Valor	Perc. s/ Segmento
Valor a Pagar	-31,07	0,00%
Valor a Pagar IRF	0,00	0,00%
Valor a Receber	0,00	0,00%
Total	-31,07	0,00%

Provisão para Perda		
Descrição	Valor	Perc. s/ Segmento
Provisão para Perda	-6.715.857,68	-13,55%
Total	-6.715.857,68	-13,55%
Total Segmento de Renda Fixa	49.579.305,35	

Composição do Segmento Renda Variável			
Ações	Mercado à Vista		Perc. s/ Segmento
	Valor Mercado		
ACESITA/ON	660.800,00		1,62%
BRASILINVEST	0,04		0,00%
AMBEV/PN	1.782.680,00		4,37%
BRASIL TELECOM/PN	905.400,00		2,22%
BRASKEM/ON	696.000,00		1,71%
CAEMI METAL/PN	680.000,00		1,67%
CELESC/PNB	504.000,00		1,24%
CESP/ON	622.820,00		1,53%
COMGAS/PNA	785.649,50		1,93%
COPAS / PN	22,00		0,00%
COPEL/PNB	891.000,00		2,18%
DURATEX/PN	729.250,00		1,79%
ELETRORAS/ON	378.300,00		0,93%
EMBRAER/ON	731.030,00		1,79%
EMBRATEL PAR/PN	334.000,00		0,82%
FOSFERTIL/PN	1.350.000,00		3,31%
GER PARANAP/ON	1.096.640,00		2,69%
GER PARANAP/PN	146.600,00		0,36%
GER TIETE/ON	1.485.000,00		3,64%
GER TIETE/PN	509.800,00		1,25%
GERDAU/PN	1.350.300,00		3,31%
GRADIENTE/PNA	581.284,00		1,42%
ITAUBANCO/PN	1.122.000,00		2,75%
Opção de VALE/PNA - JANEIRO 2006	29.000,00		0,07%
PACUCAR-CBD/PN	614.880,00		1,51%
COPAS	124,00		0,00%
PETROBRAS/PN	2.425.800,00		5,95%
POLIALDEN/PN	139,31		0,00%
SID NACIONAL/ON	749.100,00		1,84%
SOUZA CRUZ/ON	874.200,00		2,14%
TELEMAR N L/PNA	627.200,00		1,54%
TELEMAR/PN	2.470.800,00		6,06%
TELESP CL PA/PN	603.160,00		1,48%
TRAN PAULIST/ON	1.895.280,00		4,65%
AUXIPAR	0,60		0,00%
UNIPAR/PNB	430.000,00		1,05%
USIMINAS/PNA	1.936.550,00		4,75%
VALE R DOCE/PNA	2.522.400,00		6,18%
Total	32.521.209,45		79,71%
Fundos de Renda Variável			
Fundo	Valor Mercado		Perc. s/ Segmento
BRASIL PRIVATE EQUITY	2.686.519,64		6,58%
Total	2.686.519,64		6,58%
Outros Títulos			
Grupo	Valor Mercado		Perc. s/ Segmento
DEBENTURE PL	5.593.018,81		13,71%
Total	0,00		0,00%
Total Segmento de Renda Variável	40.800.747,90		
Composição do Segmento Imóveis			
Grupo	Valor Mercado		Perc. s/ Segmento
Comercial	10.250.732,92		71,70%
Outros	1.440.720,72		10,08%
Fundo Hermes Imobiliário	2.865.926,60		20,05%
Total	14.557.380,24		101,82%
Valores a Pagar e Receber			
Descrição	Valor		Perc. s/ Segmento
Valor a Pagar	389.076,30		2,72%
Valor a Receber	128.486,58		0,90%
Total	-260.589,72		-1,82%
Total Segmento Imóveis:	14.296.790,52		
Composição do Segmento Empréstimos e Financiamentos			
Empréstimos a Participantes			
Indexador	Atrasados		Não Atrasados
TR	21.679,49		1.824.706,53
TR	21.679,49		1.824.706,53
Valores a Pagar e Receber			
Descrição	Atrasados		Não Atrasados
Valor a Pagar	-		0,00
Valor a Receber	-		77.423,17
Total			77423,17
Total do Segmento:	21.679,49		1.902.129,70
Tabela Comparativa dos Limites da Política de Investimentos			
Composição da Carteira	% Investimento	Política	
		% Mínimo	% Máximo
Renda Fixa	46,51%	40	70
Renda Variável	38,27%	15	45
Investimentos Imobiliário	13,41%	12	15
Empréstimos e Financiamentos	1,80%	1	10
Responsáveis			
Nome	Tipo	Tel.	E-Mail
Eluzio Videiro Rosa	Administrador	61 224-0827	eluzio@geprev.com.br
	Responsavel		
Martinelli Auditores	Auditor de Gestão	(11) 3045 4898	wagner@martinelliauditores.com.br