

## CABEC - CAIXA DE PREVIDÊNCIA PRIVADA DO BEC

### RESUMO DO DAIEA - 1º TRIMESTRE DE 2006

TOTAL DE INVESTIMENTOS DA EFPP	LIMITES	VALOR EM RISCO	R\$	% REL AO TOTAL	R\$	% REL AO TOTAL
	RESOLUÇÃO 3121	VaR / 21dias úteis	208.509.470,82	1º T 2006	124.066.212,06	1º T 2005
Segmento de Renda Fixa	100%	0,100721	166.153.369,44	70,85%	83.636.174,37	66,56%
Segmento de Renda Variável	50%	7,351599	22.093.125,91	14,92%	22.588.579,45	18,81%
Segmento de Imóveis	14%		12.282.632,64	8,12%	12.209.860,15	10,08%
Segmento de Empréstimos	10%		3.879.056,31	2,96%	4.666.362,31	3,72%
Outros Realizáveis			4.101.286,52	3,15%	965.235,78	0,89%
<b>LISTAGEM DOS INVESTIMENTOS</b>			<b>208.509.470,82</b>	<b>100,0%</b>	<b>124.066.212,06</b>	<b>100,0%</b>
FIF - ICATU HARTFORD RENDA FIXA			6.102.603,10	2,93%	4.950.139,95	3,99%
FIF - ITAU ADVANCED			-	0,00%	2.400.468,06	1,93%
FIF - CITI PESION FUND FIF			-	0,00%	1.397.488,11	1,13%
FAC - SUL AMÉRICA OCEANO FIF - FUNDO ESCLUSIVO			69.428.193,41	33,30%	31.411.410,20	25,32%
FAC - BB SAMURAI FIF - FUNDO EXCLUSIVO			72.155.741,85	34,61%	33.943.610,37	27,36%
FAC - BRADESCO SOWETO FIC/FI			18.337.465,73	8,79%	-	0,00%
FIA - ITAU INSTITUCIONAL			20.198.682,55	9,69%	18.940.444,79	15,27%
FIA - CITI INSTITUCIONAL AÇÕES			-	0,00%	2.881.396,31	2,32%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA DE AÇÕES</b>			<b>1.894.443,36</b>	<b>0,91%</b>	<b>766.738,35</b>	<b>0,62%</b>
BRASIL TELECON			6.406,12	0,00%	4.551,71	0,00%
BEC ON			1.033.694,96	0,50%	477.728,29	0,39%
BEC PN			805.019,70	0,39%	241.505,91	0,19%
TEF DATA BRA ON			91,18	0,00%	74,29	0,00%
TELE CTR OESON			-	0,00%	2.412,58	0,00%
TELE LEST CLON			-	0,00%	67,48	0,00%
TELE NORT CLON			138,24	0,00%	116,32	0,00%
TELE SUDESTON			-	0,00%	746,99	0,00%
TELEBRAS ON			16,86	0,00%	10,11	0,00%
TELEMAR N L ON			13.384,80	0,01%	10.998,52	0,01%
TELEMAR PN			720,20	0,00%	831,40	0,00%
TELEMIG CLON			20.400,17	0,01%	18.714,45	0,02%
TELESP CL PAON			4.510,80	0,00%	837,91	0,00%
TELESP ON			7.134,96	0,00%	6.870,59	0,01%
TIM PART S/A DIR ON			-	0,00%	3,95	0,00%
TIM PART S/AON			2.870,97	0,00%	1.267,85	0,00%
CONTAX PN			54,40	0,00%	-	0,00%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA DE RF - CDB's /DEBÊNTURES</b>			<b>129.365,35</b>	<b>0,06%</b>	<b>9.533.057,68</b>	<b>7,68%</b>
BEC S/A			-	0,00%	866.475,61	0,70%
BEC S/A			-	0,00%	2.568.869,80	2,07%
BEC S/A			-	0,00%	569.299,27	0,46%
BEC S/A			-	0,00%	2.050.620,04	1,65%
BEC S/A			-	0,00%	414.927,18	0,33%
BEC S/A			-	0,00%	587.758,81	0,47%
BEC S/A			-	0,00%	321.305,87	0,26%
BEC S/A			-	0,00%	348.095,38	0,28%
BEC S/A			-	0,00%	82.542,47	0,07%
BEC S/A			-	0,00%	349.361,60	0,28%
BEC S/A			-	0,00%	284.137,54	0,23%
BEC S/A			-	0,00%	524.126,82	0,42%
BEC S/A			-	0,00%	282.443,43	0,23%
BEC S/A			-	0,00%	282.443,43	0,23%
BEC S/A			128.808,56	0,06%	-	0,00%
DEBÊNTURES DA CIA VALE DO RIO DOCE			556,79	0,0%	650,43	0,00%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA DE IMÓVEIS</b>			<b>12.282.632,64</b>	<b>5,89%</b>	<b>12.209.860,15</b>	<b>9,84%</b>
<b>TERRENOS</b>			<b>574.800,00</b>	<b>0,28%</b>	<b>1.114.053,94</b>	<b>0,90%</b>
- TERRENO DISTRITO MANGABEIRA - EUZÉBIO			-	0,00%	77.589,91	0,06%
- LOTES 07 E 08 - QD 50 - LAGOA REDONDA			-	0,00%	73.600,00	0,06%
- LOTES 05 A 12 - QD F - JARDIM DAS NAÇÕES			-	0,00%	231.864,51	0,19%
- LOTES , 3, 4 E 5 - PRAIA DO FUTURO			228.400,00	0,11%	228.400,00	0,18%
- LOTEAMENTO PRAIA ANTONIO DIOGO - QD 51			341.000,00	0,16%	341.000,00	0,27%
- TERRENO URBANO DE 2 FRENTES - R 7 DE SETEMBRO - PARANGABA			-	0,00%	130.744,32	0,11%
- ALUGUEIS A RECEBER/IPTU TERRENOS			-	0,00%	122,20	0,00%
- IPTU/TERRENOS			5.400,00	0,00%	5.733,00	0,00%
- VALORES A RECEBER			-	0,00%	25.000,00	0,02%
<b>EDIFICAÇÕES DE USO PRÓPRIO</b>			<b>414.582,72</b>	<b>0,20%</b>	<b>421.648,08</b>	<b>0,34%</b>

- PRÉDIO COMERCIAL - SEDE DA CABEC - R MAJOR FACUNDO, 907	413.601,72	0,20%	420.667,08	0,34%
- IPTU/USO PRÓPRIO	981,00		981,00	0,00%
<b>EDIFICAÇÕES LOCADAS A PATROCINADORA</b>	<b>1.553.428,10</b>	<b>0,75%</b>	<b>1.576.476,37</b>	<b>1,27%</b>
- PRÉDIO COMERCIAL AV. ANTONIO SALES, 2187	127.297,16	0,06%	130.141,88	0,10%
- PRÉDIO COMERCIAL RUA SENADOR POMPEU, 970	685.482,05	0,33%	696.618,53	0,56%
- PRÉDIO COMERCIAL AV. GOMES DE MATOS, 1270	456.333,47	0,22%	462.992,51	0,37%
- PRÉDIO COMERCIAL QD 2 1ª ETAPA CONJUNTO CEARÁ	261.087,89	0,13%	265.050,05	0,21%
- ALUGUÉIS A RECEBER	23.227,53	0,01%	21.673,40	0,02%
<b>EDIFICAÇÕES PARA RENDA (ALUGADAS A TERCEIROS)</b>	<b>7.202.479,81</b>	<b>3,45%</b>	<b>7.209.133,40</b>	<b>5,81%</b>
- PRÉDIO COMERCIAL AV. ANTONIO SALES, 2187	1.691.590,95	0,81%	1.729.397,19	1,39%
- PRÉDIO COMERCIAL AV. BARÃO DE STUDART, 1071	439.737,47	0,21%	441.087,59	0,36%
- PRÉDIO COMERCIAL - RUA MAJOR FACUNDO, 661	397.102,36	0,19%	401.078,68	0,32%
- 3 LOJAS - AV. BEZERRA DE MENEZES,	88.961,72	0,04%	90.949,64	0,07%
- LOJAS - SENADOR FERNANDES TÁVORA, 1845	132.147,90	0,06%	133.430,70	0,11%
- PRÉDIO COMERCIAL - AV. MONSENHOR TABOSA, 634	920.833,47	0,44%	934.695,39	0,75%
- PRÉDIO COMERCIAL - RUA GONÇALVES LÊDO,	162.870,46	0,08%	163.682,98	0,13%
- PRÉDIO COMERCIAL NA AV BARÃO DE STUDART, 1081	544.404,11	0,26%	546.129,59	0,44%
- APTO. 801 - R. CORONEL LINHARES, 115	164.522,29	0,08%	173.791,09	0,14%
- 2 LOJAS Nº 11 e 12 - AV. JOSÉ BASTOS, 4140	61.317,14	0,03%	62.687,30	0,05%
- LOJA COMERCIAL AV DA ABOLIÇÃO, 2066	42.121,12	0,02%	43.062,40	0,03%
- LOJA COMERCIAL 820 R.DESEMB LEITE ALBUQUERQUE, 832	58.683,82	0,03%	59.995,18	0,05%
- LOJA TORRE QUIXADÁ - AV. BR. DE STUDART, 2360 A	852.154,24	0,41%	871.196,80	0,70%
- LOJA TORRE QUIXADÁ - AV. BR. DE STUDART, 2360 B	852.154,24	0,41%	871.196,80	0,70%
- LOJA COMERCIAL RUA FLORIANO PEIXOTO, 918	198.486,82	0,10%	200.177,02	0,16%
- PRÉDIO COMERCIAL RUA PEDRO PEREIRA, 491	83.718,41	0,04%	84.488,69	0,07%
- ALUGUÉIS A RECEBER	200.539,64	0,10%	177.310,52	0,14%
- DEP. JUDICIAL IPTU	430.479,31	0,21%	331.875,93	0,27%
- VALORES A RECEBER	600,97	0,00%	531,53	0,00%
- (-) DEPRECIÇÃO/ PROVISÃO PARA CRED DUVIDOSA	(125.427,63)	-0,06%	(113.040,62)	-0,09%
- IPTU/LOC A TERCEIROS	5.481,00	0,00%	5.409,00	0,00%
<b>INVESTIMENTO EM SHOPPING CENTER</b>	<b>1.482.797,43</b>	<b>0,71%</b>	<b>969.109,04</b>	<b>0,78%</b>
- SHOPPING CENTER PENHA (2,48%)	1.479.245,60	0,71%	965.960,00	0,78%
- ALUGUEIS A RECEBER/SHOPPING	3.551,83	0,00%	3.149,04	0,00%
<b>IMÓVEIS ALIENADOS</b>	<b>607.315,07</b>	<b>0,29%</b>	<b>462.214,65</b>	<b>0,37%</b>
- TERRENO - DUQUE DE CAXIAS / ASSUNÇÃO	607.315,07	0,29%	462.214,65	0,37%
<b>IMÓVEIS DESTINADOS A VENDA</b>	<b>447.229,51</b>	<b>0,21%</b>	<b>457.224,67</b>	<b>0,37%</b>
- IMÓVEIS A VENDA	447.229,51	0,21%	457.224,67	0,37%
<b>EMPRÉSTIMOS</b>	<b>3.879.056,31</b>	<b>1,86%</b>	<b>4.666.362,31</b>	<b>3,76%</b>
<b>OUTROS REALIZÁVEIS</b>	<b>4.101.286,52</b>	<b>1,97%</b>	<b>965.235,78</b>	<b>0,78%</b>
<b>TOTAL SOB GESTÃO TERCEIRIZADA</b>	<b>167.885.220,91</b>	<b>70,8%</b>	<b>95.924.957,79</b>	<b>77,32%</b>
FIF - ICATU HARTFORD RENDA FIXA	6.102.603,10	2,93%	4.950.139,95	3,99%
FIF - ITAU ADVANCED	-	0,00%	2.400.468,06	1,93%
FIF - CITI PESION FUND FIF	-	0,00%	1.397.488,11	1,13%
FAC - SUL AMÉRICA OCEANO FIF - FUNDO ESCLUSIVO	69.428.193,41	33,30%	31.411.410,20	25,32%
FAC - BB SAMURAI FIF - FUNDO EXCLUSIVO	72.155.741,85	34,61%	33.943.610,37	27,36%
FIA - ITAU INSTITUCIONAL	20.198.682,55	9,69%	18.940.444,79	15,27%
FIA - CITI INSTITUCIONAL AÇÕES	-	0,00%	2.881.396,31	2,32%
FAC - BRADESCO SOWETO FIC/FI	18.337.465,73	8,79%	-	0,00%

	RENTABILIDADE NO PERÍODO	RENTABILIDADE NO PERÍODO	Benchmarks
	JAN A MAR/06	JAN A MAR/05	
<b>CARTEIRA CONSOLIDADA DA EFPP</b>	<b>5,55%</b>	<b>3,83%</b>	<b>INPC+6%</b>
Segmento de Renda Fixa	4,10%	4,34%	CDI
Segmento de Renda Variável	14,67%	3,47%	IBovespa
Segmento de Imóveis	6,31%	0,66%	INPC+6%
Segmento de Empréstimos	4,62%	4,43%	INPC+6%
CDI	4,04%	4,18%	
IBovespa	13,70%	1,51%	
INPC+6% ao ano	2,37%	3,24%	

Empresa Responsável pela Auditoria de Gestão da CABEC.

Tufani, Reis & Soares - Auditores e Consultores.

ADMINISTRADOR RESPONSÁVEL

Conforme o Artigo 54 do regulamento anexo a Resolução CMN no 2.829 do Banco Central do Brasil, e parágrafo 5o do Artigo 35 da Lei Complementar no 109, toda entidade fechada de previdência complementar deve designar um administrador estatutário tecnicamente qualificado, responsável pela gestão, alocação, supervisão e acompanhamento de seus recursos, bem como pela prestação de informações relativas a aplicação dos mesmos, sem prejuízo da responsabilidade solidária dos demais administradores da Entidade. Deste modo, a Sr. Walter de Carvalho Parente, é nomeado o Administrador Responsável da CABEC. A tabela abaixo apresenta algumas informações cadastrais do Administrador Responsável da CABEC.

Informações cadastrais do Administrador Responsável da CABEC

Nome: Walter de Carvalho Parente

CPF: 122.669.573-68

Cargo: Interventor da CABEC

Telefone para Contato: 0XX 85 3252.3700

E-mail para Contato: invest@cabec.com.br