

1 – Investimentos totais por segmento – jun/05

INVESTIMENTOS TOTAIS POR SEGMENTO - jun/05		
A - Disponível		597.001,75
B - Segmento de Renda Fixa		68.795.088,74
	1 - Carteiras Próprias	60.096.087,98
	2 - Valores a Pagar (-)	-
	3 - Valores a Receber (+)	8.699.000,76
C - Segmento de Renda Variável		78.132.282,00
	1 - Carteiras Próprias	67.498.935,67
	2 - Valores a Pagar (-)	-
	3 - Valores a Receber (+)	10.633.346,33
D - Segmento de Imóveis		87.844.825,04
	1 - Carteiras Próprias	69.281.615,61
	2 - Valores a Pagar (-)	-
	3 - Valores a Receber (+)	18.563.209,43
E - Segmento de Empréstimos e Financiamentos		19.471.299,71
	1 - Carteiras Próprias	19.179.704,82
	2 - Valores a Pagar (-)	-
	3 - Valores a Receber (+)	291.594,89
F - Fundos de Investimentos		22.985.949,26
	1 - Fundos FIEIX	-
	2 - Fundos de Direitos Creditórios	9.731.796,85
	3 - Fundos de Renda Fixa	1.606.673,03
	4 - Fundos de Renda Variável	11.647.479,38
	5 - Fundos em Empresas Emergentes	-
	6 - Fundos em Participação	-
	7 - Fundos Imobiliários	-
G - Investimentos Totais		277.826.446,50

2 - Rentabilidade por segmento

Rentabilidade por Segmento	jan/05	fev/05	mar/05	abr/05	mai/05	jun/05	acumulada
Segmento de Renda Fixa	1,28%	0,95%	1,73%	1,47%	1,31%	1,32%	8,33%
Carteira de RF com baixo risco crédito	1,33%	1,27%	1,38%	1,46%	1,47%	1,56%	8,77%
Carteira de RF com médio / alto risco crédito	1,07%	-0,18%	3,25%	1,54%	0,62%	0,31%	6,75%
Segmento de Renda Variável	-8,52%	15,20%	-4,56%	-6,53%	-0,22%	-1,01%	-7,14%
Carteira de Ações em Mercado	-8,52%	15,20%	-4,56%	-6,53%	-0,22%	-1,01%	-7,14%
Segmento de Imóveis	1,07%	0,84%	0,79%	1,10%	0,87%	0,75%	5,55%
Segmento Empréstimos & Financiamentos	1,83%	2,03%	2,04%	2,06%	2,39%	2,14%	13,15%
Global	-2,22%	5,78%	-0,79%	-1,35%	0,75%	0,22%	2,21%

3 - Enquadramento

Posição de enquadramento dos investimentos
de acordo com a Resolução nº 3121 de 26/09/03

posição em 30/06/05

Segmentos Principais	Valores por segmento	% Portus sobre os R.G.R.T.	Limite máximo permitido
Tes. Nacional	57.097.855,58	20,55%	100%
risco	7.162.207,60	2,58%	80%
Títulos de Renda Fixa sem classificação de risco	15.856.636,61	5,71%	20%
Títulos de Renda Variável	90.393.621,96	32,54%	50%
Carteira Imobiliária	87.844.825,04	31,62%	14%
Empréstimos e financiamentos	19.471.299,71	7,01%	15%
Recursos Garantidores das Reservas Técnicas	277.826.446,50	100,00%	

Obs.: Os valores por segmento dos investimentos incluem, além do estoque, a diferença entre os valores a pagar e a receber. No quadro abaixo, estão explícitos tais valores:

Segmentos Principais	Valor do estoque	Valor a receber / a pagar	Saldo total
Renda Fixa emitido pelo Tes. Nacional	57.097.855,58	-	57.097.855,58
Títulos de Renda Fixa de baixo risco	7.162.207,60	-	7.162.207,60
Títulos de Renda Fixa sem classificação de risco	7.157.635,85	8.699.000,76	15.856.636,61
Títulos de Renda Variável	79.760.275,63	10.633.346,33	90.393.621,96
Carteira Imobiliária	69.281.615,61	18.563.209,43	87.844.825,04
Empréstimos e financiamentos	19.179.704,82	291.594,89	19.471.299,71
Total geral	239.639.295,09	38.187.151,41	277.826.446,50

4 - Demonstrativo Analítico de Investimentos e Enquadramento das Aplicações

ATIVO		PASSIVO	
DISPONÍVEL	597.001,75	EXIGÍVEL OPERACIONAL	5.407.363,33
		Programa Previdencial	4.359.173,04
REALIZÁVEL	416.222.879,42	Programa Administrativo	1.048.190,29
Programa Previdencial	137.643.208,63		
Programa Administrativo	1.350.226,04	EXIGÍVEL CONTINGENCIAL	723.819,65
Programa de Investimentos	277.229.444,75	Programa Administrativo	723.819,65
PERMANENTE	451.308,63		
Imobilizado	349.472,97	EXIGÍVEL ATUARIAL	1.535.347.842,69
Diferido	101.835,66	Provisões Matemáticas	1.535.347.842,69
		Benefícios Concedidos	1.168.465.408,56
		Benefícios a Conceder	538.935.797,83
		Provisão Matemática a Constituir (-)	(172.053.363,70)
		RESERVAS E FUNDOS	(1.124.207.835,87)
		Déficit / Superávit Técnico	(1.148.181.613,26)
		Fundos	23.973.777,39
		Administrativo	22.992.245,54
		Investimentos	981.531,85
TOTAL DO ATIVO	417.271.189,80	TOTAL DO PASSIVO	417.271.189,80