

1 – Dados cadastrais

| | |
|-----------------------|---------------------------------------|
| Mês/Ano: | jun/2006 |
| Nome da Entidade: | PORTUS INSTITUTO DE SEGURIDADE SOCIAL |
| Sigla da Entidade: | PORTUS |
| Código da Entidade: | 686 |
| Estado da Entidade: | RJ |
| Nome do Plano: | PBP1 |
| Código do Plano: | 1 |
| Tipo do Plano: | BD |
| Investimentos Totais: | 272.024.574,10 |
| Data da Carteira: | 30/jun/06 |

Informações sobre o Diretor-Presidente da Entidade

| | |
|------------------------|------------------------------------|
| Nome: | Wildjan da Fonseca Magno |
| CPF: | 002.902.891-49 |
| Início do Mandato: | 4/8/2005 |
| Fim do Mandato: | 3/10/2006 |
| Telefone para Contato: | (21) 2122-8502 |
| e-mail: | presidencia@portusinstituto.com.br |

Informações sobre o Diretor Financeiro da Entidade

| | |
|------------------------|-------------------------------|
| Nome: | Adrei Antonio Degásperi |
| CPF: | 220.386.478-87 |
| Início do Mandato: | 4/8/2005 |
| Fim do Mandato: | 3/10/2006 |
| Telefone para Contato: | (21) 2122-8506 |
| e-mail: | dirfin@portusinstituto.com.br |

Informações sobre o Administrador Responsável

| | |
|------------------------|-------------------------------|
| Nome: | Adrei Antonio Degásperi |
| CPF: | 220.386.478-87 |
| Início do Mandato: | 4/8/2005 |
| Fim do Mandato: | 3/10/2006 |
| Cargo: | Diretor Financeiro |
| Telefone para Contato: | (21) 2122-8506 |
| e-mail: | dirfin@portusinstituto.com.br |

| Informações sobre o Responsável pela Prestação de Informações | |
|--|---|
| Nome: | Eduardo Leis do Espírito Santo |
| CPF: | 768.782.287-00 |
| Cargo: | Gerente de Aplicação e Análise Interino |
| Telefone para Contato: | (21) 2122-8531 |
| e-mail: | financeiro@portusinstituto.com.br |

| Informações sobre o Responsável pela Consolidação | |
|--|--|
| Nome: | HSBC Corretora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. |
| CNPJ: | 58.229.246/0001-10 |
| Pessoa Responsável: | Rogério Penteado Felgueiras |
| Cargo: | DIRETOR |
| Telefone para Contato: | (11) 3847-9372 |
| e-mail: | rogerio.p.felgueiras@hsbc.com.br |
| CPF da Pessoa Responsável: | 012.571.987-69 |

| Informações sobre o Responsável pelo Controle de Risco | |
|---|--|
| Nome (Pessoa ou Empresa): | HSBC Corretora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. |
| CPF (ou CNPJ): | 58.229.246/0001-10 |
| Pessoa Resp. se Empresa: | Rogério Penteado Felgueiras |
| Cargo: | DIRETOR |
| Telefone para Contato: | (11) 3847-9372 |
| e-mail: | rogerio.p.felgueiras@hsbc.com.br |
| CPF da Pessoa Responsável: | 012.571.987-69 |

| Informações sobre o Auditor Independente | |
|---|--|
| Nome: | Fernando Motta & Associados |
| CNPJ: | 17.508.672/0002-96 |
| Pessoa Responsável: | Luiz Alberto Rodrigues Mourão |
| Cargo: | Diretor |
| Telefone para Contato: | (21) 2262-1099 |
| e-mail: | fmotta_rio@fmotta.com.br |
| CPF da Pessoa Responsável: | 435.269.187-91 |

| Lista de Custodiantes da Carteira Própria | |
|--|---------------------|
| Custodiante | CNPJ do Custodiante |
| HSBC Corretora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. | 58.229.246/0001-10 |

2 - Investimentos totais por segmento – jun/06

| | | |
|--|-----------------------------|----------------|
| A - Disponível | | 662.282,06 |
| B - Segmento de Renda Fixa | | 93.131.382,68 |
| | 1 - Carteiras Próprias | 78.884.215,37 |
| | 2 - Valores a Pagar (-) | - |
| | 3 - Valores a Receber (+) | 14.247.167,31 |
| C - Segmento de Renda Variável | | 73.743.499,19 |
| | 1 - Carteiras Próprias | 64.400.205,77 |
| | 2 - Valores a Pagar (-) | - |
| | 3 - Valores a Receber (+) | 9.343.293,42 |
| D - Segmento de Imóveis | | 80.987.914,51 |
| | 1 - Carteiras Próprias | 52.906.988,78 |
| | 2 - Valores a Pagar (-) | - |
| | 3 - Valores a Receber (+) | 28.080.925,73 |
| E - Segmento de Empréstimos e Financiamentos | | 23.499.495,66 |
| | 1 - Carteiras Próprias | 23.090.996,43 |
| | 2 - Valores a Pagar (-) | - |
| | 3 - Valores a Receber (+) | 408.499,23 |
| F - Investimentos Totais | | 272.024.574,10 |

3 – Rentabilidade por segmento

| Rentabilidade por Segmento | jan/06 | fev/06 | mar/06 | abr/06 | mai/06 | jun/06 | 6 meses acumulada |
|--|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|------------------------------|
| Segmento de Renda Fixa | 1,56% | 2,62% | 0,72% | 0,72% | 0,02% | 1,31% | 7,14% |
| Carteira de RF com baixo risco crédito | 1,56% | 3,70% | 0,79% | 0,94% | -0,47% | 1,27% | 8,00% |
| Carteira de RF com médio / alto risco crédito | 1,58% | 0,59% | 0,59% | 0,26% | 1,07% | 1,38% | 5,59% |
| Segmento de Renda Variável | 10,10% | -0,27% | -0,98% | 3,67% | -5,44% | -0,60% | 5,95% |
| Carteira de Ações em Mercado | 10,10% | -0,27% | -0,98% | 3,67% | -5,44% | -0,60% | 5,95% |
| Segmento de Imóveis | 1,16% | 0,88% | 0,74% | 2,10% | 0,89% | 1,08% | 7,06% |
| Segmento Empréstimos & Financiamentos | 3,15% | 3,00% | 1,43% | 4,56% | 2,17% | 2,16% | 17,61% |
| Global | 4,17% | 1,32% | 0,34% | 2,28% | -0,93% | 0,85% | 8,22% |

4- Enquadramento

POSIÇÃO DE ENQUADRAMENTO DOS INVESTIMENTOS
de acordo com a Resolução nº 3121 de 26/09/03

posição em 30/6/06

| SEGMENTOS | VALORES (R\$) | ALOCAÇÃO | POLÍTICA DE INV. | Res/CMN3.121/03 |
|------------------------------------|-----------------------|-----------------|-------------------------|------------------------|
| RENDA FIXA | 93.793.664,74 | 34,48% | | |
| Baixo Risco de Crédito | 71.828.329,41 | 26,41% | 60,00% a 90,00% | 0,00% a 100% |
| Títulos Públicos | 12.137.682,47 | 4,46% | | 0,00% a 100% |
| NTN | 12.137.682,47 | 4,46% | | |
| Títulos Privados | 59.690.646,94 | 21,94% | | 0,00% a 80,00% |
| CDB | 47.421.992,73 | 17,43% | | |
| Fundos | 11.606.372,15 | 4,27% | | |
| FIDC- FCVS | 11.606.372,15 | 4,27% | | |
| Saldo em tesouraria | 662.282,06 | 0,24% | | |
| Médio/Alto Risco de Crédito | 21.965.335,33 | 8,07% | 0,00% a 10,00% | 0,00% a 20,00% |
| Debêntures Conversíveis | 1.946.302,69 | 0,72% | | |
| Debêntures não Conversíveis | 7.718.168,02 | 2,84% | | |
| Notas Promissórias | 12.300.864,62 | 4,52% | | |
| RENDA VARIÁVEL | 73.743.499,19 | 27,11% | 0,00% a 50,00% | 0,00% a 50,00% |
| Ações em mercado | 53.748.562,32 | 19,76% | | |
| Valores a receber / (pagar) | 9.343.293,42 | 3,43% | | |
| Fundos | 10.651.643,45 | 3,92% | | |
| IMÓVEIS + Valores a receber | 80.987.914,51 | 29,77% | | |
| IMÓVEIS | 52.906.988,78 | 19,45% | 5,00% a 23,00% | 0,00% a 11,00% |
| Imóveis valores a receber | 28.080.925,73 | 10,32% | | |
| EMPRÉSTIMOS/FINANC. | 23.499.495,66 | 8,64% | 0,00% a 10,00% | 0,00% a 15,00% |
| TOTAL | 272.024.574,10 | 100,00% | | |

5 – Balanço

| ATIVO | | PASSIVO | |
|---------------------------|------------------------------|--------------------------------------|----------------------------------|
| DISPONÍVEL | <u>662.282,06</u> | EXIGÍVEL OPERACIONAL | <u>5.867.643,16</u> |
| | | Programa Previdencial | 4.756.151,94 |
| REALIZÁVEL | <u>537.294.999,96</u> | Programa Administrativo | 1.111.491,22 |
| Programa Previdencial | 264.134.453,82 | Programa Investimentos | - |
| Programa Administrativo | 1.798.254,10 | EXIGÍVEL CONTINGENCIAL | <u>12.212.326,67</u> |
| Programa de Investimentos | 271.362.292,04 | Programa Previdencial | 11.488.507,02 |
| | | Programa Administrativo | 723.819,65 |
| PERMANENTE | <u>450.213,96</u> | EXIGÍVEL ATUARIAL | <u>1.672.907.707,51</u> |
| Imobilizado | 447.897,61 | Provisões Matemáticas | <u>1.672.907.707,51</u> |
| Diferido | 2.316,35 | Benefícios Concedidos | 1.178.493.124,13 |
| | | Benefícios a Conceder | 667.471.643,45 |
| | | Provisão Matemática a Constituir (-) | (173.057.060,07) |
| | | RESERVAS E FUNDOS | <u>(1.152.580.181,36)</u> |
| | | Superávit Técnico Acumulado | - |
| | | Déficit / Superávit Técnico | <u>(1.176.971.901,58)</u> |
| | | Fundo | <u>24.391.720,22</u> |
| | | Administrativo | 22.515.407,12 |
| | | Investimentos | 1.876.313,10 |
| TOTAL DO ATIVO | <u>538.407.495,98</u> | TOTAL DO PASSIVO | <u>538.407.495,98</u> |

CUSTOS COM A GESTÃO - 1º Semestre 2006

Valores em R\$

| Despesas | Gestão Previdencial | Gestão de Investimentos | Total |
|-----------------------------------|----------------------------|--------------------------------|---------------------|
| Pessoal e Encargos | 2.461.980,50 | 655.565,51 | 3.117.546,01 |
| Proventos | 1.282.093,54 | 384.956,07 | 1.667.049,61 |
| Benefícios | 626.934,13 | 139.140,51 | 766.074,64 |
| Encargos e Contribuições Sociais | 552.952,83 | 131.468,93 | 684.421,76 |
| Serviços de Terceiros | 957.245,18 | 72.169,35 | 1.029.414,53 |
| Atuária Externa | 137.470,18 | - | 137.470,18 |
| Honorários Advocatícios | 79.422,06 | - | 79.422,06 |
| Assessoria Técnica | 238.569,97 | 18.884,35 | 257.454,32 |
| Conservação e Limpeza | 28.834,59 | - | 28.834,59 |
| Manut.Conservação de Bens | 12.255,60 | - | 12.255,60 |
| Manut.Maç. e Equipamentos | 10.191,73 | - | 10.191,73 |
| Impressão Encardenação Publicação | 19.745,35 | - | 19.745,35 |
| Microfilmagem | 3.128,31 | - | 3.128,31 |
| Frete e Armazenagem | 17.622,73 | - | 17.622,73 |
| Terceirização Administrativa | 47.392,07 | - | 47.392,07 |
| Terceirização Informática | 362.612,59 | - | 362.612,59 |
| Custódia | - | 17.762,75 | 17.762,75 |
| Processamento de Dados | - | 35.522,25 | 35.522,25 |
| Despesas Gerais | 901.042,78 | 350.041,39 | 1.251.084,17 |
| Depreciação / Amortização | 67.059,23 | - | 67.059,23 |
| Total Geral | 4.387.327,69 | 1.077.776,25 | 5.465.103,94 |

Instrução SPC nº 07, 10 de agosto de 2005

Fonte: Gerência de Contabilidade/Portus