

1 – Dados cadastrais

Mês/Ano:	dez/2005
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:	280.479.191,53
Data da Carteira:	30/dez/05

Informações sobre o Presidente/Superintendente 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:	Alexander Américo Abido Soares da Silva
CPF:	005.927.597-92
Cargo:	Gerente de Aplicação e Análise
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:	Taíbio Franzin Jr.
Cargo:	DIRETOR
Telefone para Contato:	(11) 3847-9372
e-mail:	tfranzin@hsbc.com.br
CPF da Pessoa Responsável:	462.387.009-04

Informações sobre o Responsável

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:	Taíbio Franzin Jr.
Cargo:	DIRETOR
Telefone para Contato:	(11) 3847-9372
e-mail:	tfranzin@hsbc.com.br
CPF da Pessoa Responsável:	462.387.009-04

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	58.229.246/0001-10

2 – Investimentos totais por segmento – dez/05

A - Disponível		2.000.095,13
B - Segmento de Renda Fixa		83.591.951,15
	1 - Carteiras Próprias	59.048.046,36
	2 - Valores a Pagar (-)	-
	3 - Valores a Receber (+)	24.543.904,79
C - Segmento de Renda Variável		60.071.196,58
	1 - Carteiras Próprias	60.530.563,96
	2 - Valores a Pagar (-)	1.093.233,01
	3 - Valores a Receber (+)	633.865,63
D - Segmento de Imóveis		85.229.181,30
	1 - Carteiras Próprias	56.584.545,59
	2 - Valores a Pagar (-)	-
	3 - Valores a Receber (+)	28.644.635,71
E - Segmento de Empréstimos e Financiamentos		23.351.558,74
	1 - Carteiras Próprias	22.568.161,52
	2 - Valores a Pagar (-)	-
	3 - Valores a Receber (+)	783.397,22
F - Fundos de Investimentos		26.235.208,63
	1 - Fundos FIEEX	-
	2 - Fundos de Direitos Creditórios	10.656.372,13
	3 - Fundos de Renda Fixa	780.396,58
	4 - Fundos de Renda Variável	13.752.043,93
	5 - Fundos em Empresas Emergentes	-
	6 - Fundos em Participação	-
	7 - Fundos Imobiliários	1.046.395,99
G - Investimentos Totais		280.479.191,53

3 – Rentabilidade por segmento

Rentabilidade por Segmento	jan/05	fev/05	mar/05	abr/05	mai/05	jun/05	6 meses 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%

Rentabilidade por Segmento	jul/05	ago/05	set/05	out/05	nov/05	dez/05	12 meses acumulada
Segmento de Renda Fixa	1,23%	1,30%	2,46%	9,58%	1,32%	1,28%	27,46%
Carteira de RF com baixo risco crédito	1,43%	1,59%	1,39%	1,43%	1,41%	1,45%	18,13%
Carteira de RF com médio / alto risco crédito	0,40%	0,17%	6,57%	44,50%	1,08%	0,76%	68,84%
Segmento de Renda Variável	3,26%	6,21%	7,67%	-4,67%	3,92%	5,14%	14,60%
Carteira de Ações em Mercado	3,26%	6,21%	7,67%	-4,67%	3,92%	5,14%	14,60%
Segmento de Imóveis	-0,83%	1,63%	0,83%	3,08%	0,86%	0,03%	11,69%
Segmento Empréstimos & Financiamentos	2,43%	2,35%	2,23%	0,41%	3,30%	3,75%	30,44%
Global	1,32%	3,19%	3,75%	2,05%	2,14%	2,20%	18,11%

4 – Enquadramento

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

posição em 30/12/05

SEGMENTOS	VALORES (R\$)	ALOCAÇÃO	POLÍTICA DE INV.	Res/CMN3.121/03
RENDA FIXA	96.668.958,64	34,47%		
Baixo Risco de Crédito	64.832.524,10	23,11%	60,00% a 90,00%	0,00% a 100%
Títulos públicos	45.179.602,39	16,11%		0,00% a 100%
LFT	33.223.026,39	11,85%		
NTN	11.956.576,00	4,26%		
Títulos Privados	17.652.826,58	6,29%		0,00% a 80,00%
CDB	6.575.914,24	2,34%		
Fundos	11.076.912,34	3,95%		
FIF RF	420.540,21	0,15%		
FIDC- FCVS	10.656.372,13	3,80%		
Saldo em tesouraria	2.000.095,13	0,71%		
Médio/Alto Risco de Crédito	31.836.434,54	11,35%	0,00% a 10,00%	0,00% a 20,00%
Debêntures Conversíveis	2.191.171,55	0,78%		
Debêntures não Conversíveis	7.292.529,75	2,60%		
Notas Promissórias	22.352.733,24	7,97%		
RENDA VARIÁVEL	74.183.096,86	26,45%	0,00% a 50,00%	0,00% a 50,00%
Ações em mercado	60.530.563,94	21,58%		
Valores a receber / (pagar)	(459.367,38)	-0,16%		
Fundos	14.111.900,30	5,03%		
IMÓVEIS + Valores a receber	86.275.577,29	30,76%		
IMÓVEIS	57.630.941,58	20,55%	5,00% a 23,00%	0,00% a 14,00%
Imóveis valores a receber	28.644.635,71	10,21%		
EMPRÉSTIMOS/FINANC.	23.351.558,74	8,33%	0,00% a 10,00%	0,00% a 15,00%
TOTAL	280.479.191,53	100,00%		

5 – Demonstrativo Analítico de Investimentos e Enquadramento das Aplicações

ATIVO		PASSIVO	
DISPONÍVEL	<u>2.000.095,13</u>	EXIGÍVEL OPERACIONAL	<u>2.330.932,44</u>
		Programa Previdencial	291.900,72
REALIZÁVEL	<u>503.674.013,75</u>	Programa Administrativo	945.798,71
Programa Previdencial	222.599.466,28	Programa Investimentos	1.093.233,01
Programa Administrativo	1.502.218,06		
Programa de Investimentos	279.572.329,41	EXIGÍVEL CONTINGENCIAL	<u>723.819,65</u>
		Programa Administrativo	723.819,65
PERMANENTE	<u>479.942,31</u>		
Imobilizado	446.186,27	EXIGÍVEL ATUARIAL	<u>1.616.681.385,06</u>
Diferido	33.756,04	Provisões Matemáticas	<u>1.616.681.385,06</u>
		Benefícios Concedidos	1.167.060.248,29
		Benefícios a Conceder	621.282.748,27
		Provisão Matemática a Constituir (-)	(171.661.611,50)
		RESERVAS E FUNDOS	<u>(1.113.582.085,96)</u>
		Superávit Técnico Acumulado	-
		Déficit / Superávit Técnico	<u>(1.138.729.130,97)</u>
		Fundo	<u>25.147.045,01</u>
		Administrativo	23.568.966,01
		Investimentos	1.578.079,00
TOTAL DO ATIVO	<u>506.154.051,19</u>	TOTAL DO PASSIVO	<u>506.154.051,19</u>