

RedePrev

FUNDAÇÃO REDE DE PREVIDÊNCIA - REDEPREV
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - DI / POLÍTICA DE INVESTIMENTOS - 2º SEMESTRE/2014

Em cumprimento ao disposto na Resolução CGPC nº 23 de 06/12/2006 e na Resolução nº 3.792, de 24/09/2009, do Conselho Monetário Nacional -CMN, a Diretoria Executiva da REDEPREV apresenta a seguir as informações relativas ao Demonstrativo de Investimentos da REDEPREV, relativo ao 2º SEMESTRE/2014.

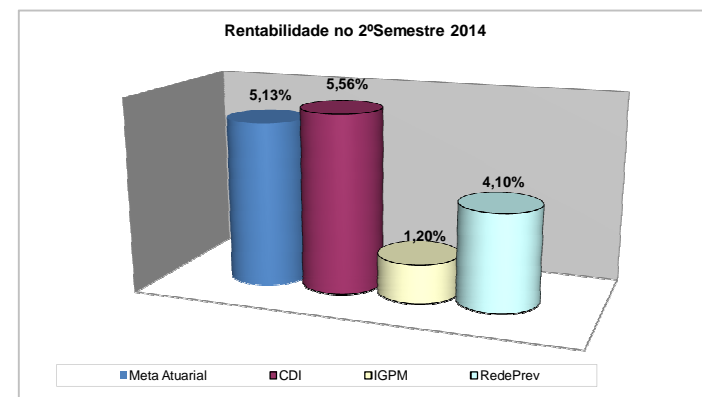
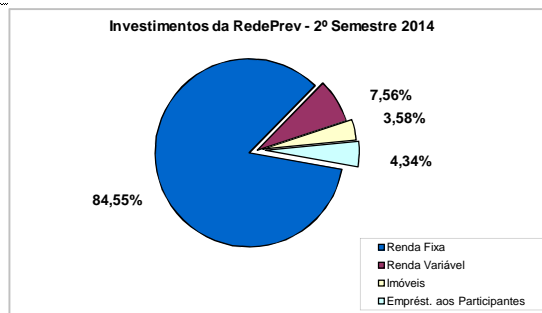
TOTAL DOS INVESTIMENTOS DA REDEPREV POR SEGMENTO, EM REAIS E EM PERCENTUAIS RELATIVOS, NO SEMESTRE DE REFERÊNCIA E NO SEMESTRE ANTERIOR					LIMITES DE ALOCAÇÃO - RES. 3.792 BACEN, POLITICA DE INVESTIMENTOS E EFETIVA			RENTABILIDADE DA REDEPREV POR SEGMENTO DE APLICAÇÃO EM COMPARAÇÃO AOS BENCHMARKS DE MERCADO E META ATUARIAL					
Segmentos	Investimentos 1º Semestre/2014 Posição em 30/06/2014		Investimentos 2º Semestre/2014 Posição em 31/12/2014		Limites de Alocação - Res. 3.792 - BACEN	Limites da Polit. de Investimentos - Percentual de Alocação	Composição Efetiva dos Investimentos	Rentabilidade REDEPREV por Segmento de Aplicação	Benchmarks de Mercado		Meta Atuarial	Relação percentual Rentabilidade REDEPREV e Benchmarks	Relação percentual Rentabilidade REDEPREV e Meta Atuarial
	%	Valor - R\$	%	Valor - R\$					Indicadores	%			
Renda Fixa	77,55%	612.217.256,36	84,55%	517.395.873,14	100,00%	Até 100%	84,55%	5,69%	CDI	5,56%	5,13%	102,34%	110,92%
Renda Variável	14,63%	115.507.565,98	7,53%	46.074.232,11	70,00%	Até 40%	7,53%	-4,58%	IBOVESPA Fechto	-5,93%	5,13%	77,23%	-89,28%
Imóveis	3,98%	31.454.323,78	3,58%	21.919.851,74	8,00%	Até 8%	3,58%	9,88%	Meta Atuarial	5,13%	5,13%	192,59%	192,59%
Emprést. aos Participantes	3,83%	30.267.876,91	4,34%	26.528.021,10	15,00%	Até 15%	4,34%	5,89%	Meta Atuarial	5,13%	5,13%	114,81%	114,81%
TOTAL	100,00%	789.447.023,03	100,00%	611.917.978,09				3,01%			5,13%		58,67%

MONTANTE DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO E GESTÃO - 2º SEMESTRE/2014				VALORES EM RISCO (VaR) P/ OS SEGMENTOS DE RENDA FIXA E VARIÁVEL		
Investimento	Valor - R\$	%em Rel. Total	Gestão	Segmentos	VaR - 2º Semestre/2014	
Segmento Renda Fixa	517.395.873,14	84,55%			%	Valor - R\$
Títulos Públicos - NTN	172.451.837,25	28,18%	Própria	R. Fixa - RF	0,27%	1.405.513,41
CDB	16.289.822,34	2,66%	Própria	R.Variável - RV	7,46%	3.258.232,52
Debêntures	35.095.311,66	5,74%	Própria	Consolidado	0,76%	4.294.908,55
Fundos de Investimentos	130.523.030,84	21,33%	Terceirizada			
DPGE/LFS	163.035.871,05	26,64%	Própria			
Segmento Renda Variável	46.074.232,11	7,53%		Planos Benef.	Rentabilidade - 2º Semestre/14	
Fundos de Investimento/Ações	46.074.232,11	7,53%	Terceirizada	Celpa OP	4,04%	
Segmento Imóveis	21.919.851,74	3,58%		Cemat OP	3,68%	
Imóveis	21.919.851,74	3,58%	Própria	Elétricas OP	4,44%	
Segm. Empréstimo Participantes	26.528.021,10	4,34%		Meta Atuarial	5,13%	
Empréstimo Financeiro	26.528.021,10	4,34%	Própria	CDI	5,56%	
TOTAL	611.917.978,09	100,00%				

CUSTOS COM ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS REALIZADOS NO 2º SEMESTRE/2014		
Instituição	Serviço	Valor - R\$
Banco Itaú	Custódia	136.316,47
Banco Itaú	Cetip/Selic/Cbhc	72.025,39
PPS/ALM	Análise de investimentos	38.405,97
Risk Office	Risco de Mercado	40.042,28
Auditoria	Auditoria de Gestão	9.159,00
Consultoria	Conselho Consultivo	9.329,00
Sist.controle Invest.	Licença de uso	93.648,32
Taxa de Adm. Fundos	Diversos Bancos	1.855.012,80
TOTAL		2.253.939,23

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado
André Bolonha Fiúza de Mello
e-mail: andre.fiúza@redeprev.com.br
Telefone: (11) 4481-9600

Empresa Responsável pela Auditoria de Gestão da REDEPREV
BDO Auditores Independentes
Ismael Nicomedio dos Santos
e-mail: ismael.nicomedio@bdobrazil.com.br
Telefone: (11) 3045-7363



ESPECIFICAÇÃO DOS DESENQUADRAMENTOS E INOBSERVÂNCIAS À RESOLUÇÃO 3.792 - BACEN
Comentários:
JUSTIFICATIVAS PARA OS DESENQUADRAMENTOS E INOBSERVÂNCIAS À RESOLUÇÃO 3.792 - BACEN

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - DI / POLÍTICA DE INVESTIMENTOS - 2º SEMESTRE/2014

Em cumprimento ao disposto na Resolução CGPC nº 23 de 06/12/2006 e na Resolução nº 3.792, de 24/09/2009, do Conselho Monetário Nacional -CMN, a Diretoria Executiva da REDEPREV apresenta a seguir as informações relativas ao Demonstrativo de Investimentos da REDEPREV, relativo ao 2º SEMESTRE / 2014.

Faixas de Alocação dos Recursos por Plano

Segmento				Celpa OP		Total Celpa	
				%	Valor - R\$	%	Valor - R\$
Renda Fixa				82,07%	113.641.501,11	82,07%	113.641.501,11
Renda Variável				7,75%	10.728.727,35	7,75%	10.728.727,35
Imóveis				3,95%	5.469.480,86	3,95%	5.469.480,86
Emp. a Participantes				6,23%	8.633.134,06	6,23%	8.633.134,06
TOTAL				100,00%	138.472.843,38	100,00%	138.472.843,38

Segmento	Cemat BDI			Cemat OP		Total Cemat	
	%	Valor - R\$		%	Valor - R\$	%	Valor - R\$
Renda Fixa	90,04%	41.189.832,92		87,34%	156.600.804,79	87,89%	197.790.637,71
Renda Variável	8,78%	4.018.116,20		8,26%	14.804.851,26	8,36%	18.822.967,46
Imóveis	0,00%	-		0,00%	-	0,00%	-
Emp. a Participantes	1,17%	537.022,17		4,40%	7.897.612,75	3,75%	8.434.634,92
TOTAL	100,00%	45.744.971,29		100,00%	179.303.268,80	100,00%	225.048.240,09

Segmento	Elétricas BDI			Elétricas OP		Total Elétricas	
	%	Valor - R\$		%	Valor - R\$	%	Valor - R\$
Renda Fixa	83,21%	61.533.169,14		77,81%	99.945.043,21	79,79%	161.478.212,35
Renda Variável	7,96%	5.885.332,10		7,50%	9.633.181,26	7,67%	15.518.513,36
Imóveis	8,44%	6.239.822,67		7,95%	10.210.548,21	8,13%	16.450.370,88
Emp. a Participantes	0,40%	293.839,24		6,74%	8.650.720,50	4,42%	8.944.559,74
TOTAL	100,00%	73.952.163,15		100,00%	128.439.493,18	100,00%	202.391.656,33

Segmento	Plano de Benefícios "R"					Total Plano de Benefícios "R"	
	%	Valor - R\$				%	Valor - R\$
Renda Fixa	96,52%	42.118.663,88				96,52%	42.118.663,88
Renda Variável	2,30%	1.004.023,94				2,30%	1.004.023,94
Imóveis	0,00%	-				0,00%	-
Emp. a Participantes	1,18%	515.692,38				1,18%	515.692,38
TOTAL	100,00%	43.638.380,20				100,00%	43.638.380,20

Segmento	Plano de Gestão Administrativa					Total Plano de Gestão Administrativa	
	%	Valor - R\$				%	Valor - R\$
Renda Fixa	100,00%	2.366.858,09				100,00%	2.366.858,09
Renda Variável	0,00%	-				0,00%	-
Imóveis	0,00%	-				0,00%	-
Emp. a Participantes	0,00%	-				-	-
TOTAL	100,00%	2.366.858,09				100,00%	2.366.858,09

TOTAL - INVESTIMENTOS REDEPREV

611.917.978,09