

RedePrev

FUNDAÇÃO REDE DE PREVIDÊNCIA - REDEPREV

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - DI / POLÍTICA DE INVESTIMENTOS - 1º SEMESTRE/2015

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 1º SEMESTRE/2015.

TOTAL DOS INVESTIMENTOS DA REDEPREV POR SEGMENTO, EM REAIS E EM PORCENTUAIS 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 2º Semestre/2014 Posição em 31/12/2014		Investimentos 1º Semestre/2015 Posição em 30/06/2014		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	84,49%	515.029.015,05	90,92%	575.393.865,93	100,00%	Até 100%	90,92%	7,65%	CDI	5,93%	9,70%	129,01%	78,87%
Renda Variável	7,56%	46.074.232,11	1,23%	7.813.612,33	70,00%	Até 40%	1,23%	15,46%	IBOVESPA Fechto	6,18%	9,70%	250,16%	159,38%
Imóveis	3,60%	21.919.851,74	3,45%	21.820.716,67	8,00%	Até 8%	3,45%	4,11%	Meta Atuarial	9,70%	9,70%	42,37%	42,37%
Emprést. aos Participantes	4,35%	26.528.021,10	4,40%	27.833.658,92	15,00%	Até 15%	4,40%	0,23%	Meta Atuarial	9,70%	9,70%	2,37%	2,37%
TOTAL	100,00%	609.551.120,00	100,00%	632.861.853,85				7,46%			9,70%		76,91%

MONTANTE DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO E GESTÃO - 1º SEMESTRE/2015				VALORES EM RISCO (VaR) P/ OS SEGMENTOS DE RENDA FIXA E VARIÁVEL		
Investimento	Valor - R\$	%em Rel. Total	Gestão	Segmentos	VaR - 1º Semestre/2015	
Segmento Renda Fixa	575.393.865,93	90,92%			%	Valor - R\$
Títulos Públicos - NTN	275.187.564,66	43,48%	Própria	R. Fixa - RF	0,19%	1.090.481,55
CDB	14.035.903,29	2,22%	Própria	R.Variável - RV	19,69%	1.428.409,16
Debêntures	37.046.197,79	5,85%	Própria	Consolidado	0,28%	1.667.138,29
Fundos de Investimentos	96.950.900,43	15,32%	Terceirizada			
DPGE/LFS	152.173.299,76	24,05%	Própria			
Segmento Renda Variável	7.813.612,33	1,23%		Planos Benef.	Rentabilidade - 1º Semestre/2015	
Fundos de Investimento/Ações	7.813.612,33	1,24%	Terceirizada	Celpa OP	7,13%	
Segmento Imóveis	21.820.716,67	3,45%		Cemat OP	7,81%	
Imóveis	21.820.716,67	3,45%	Própria	Elétricas OP	7,05%	
Segm. Empréstimo Participantes	27.833.658,92	4,40%		Meta Atuarial	9,70%	
Empréstimo Financeiro	27.833.658,92	4,40%	Própria	CDI	5,93%	
TOTAL	632.861.853,85	100,00%				

CUSTOS COM ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS REALIZADOS NO 1º SEMESTRE/2015		
Instituição	Serviço	Valor - R\$
Banco Itaú	Custódia	100.257,86
Banco Itaú	Cetip/Selic/CbIc	65.783,26
PPS/ALM	Análise de investimentos	3.068,74
Risk Office	Risco de Mercado	40.543,38
Auditoria	Auditoria de Gestão	9.159,00
Consultoria	Conselho Consultivo	22.629,00
Sist.controle Invest.	Licença de uso	68.501,88
Taxa de Adm. Fundos	Diversos Bancos	930.911,69
TOTAL		1.240.854,81

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado

André Bolonha Fiuza de Mello

e-mail: andre.fiuza@redeprev.com.br

Telefone: (11) 4481-9600

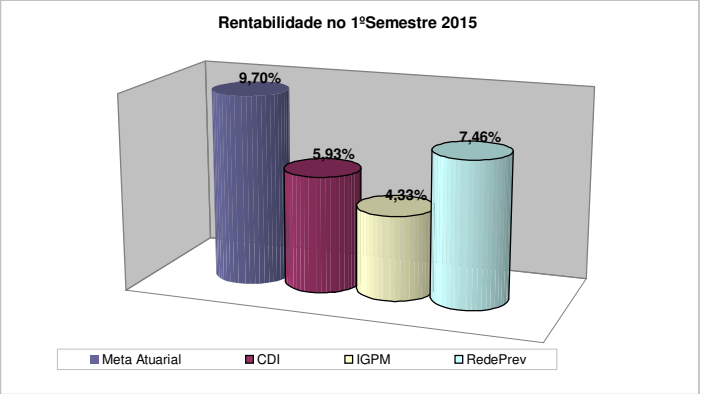
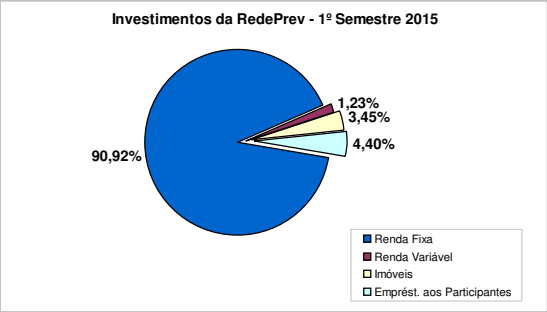
Empresa Responsável pela Auditoria de Gestão da REDEPREV

BDO RCS AUDITORES E CONSULTORES LTDA

Ismael Nicomedio dos Santos

e-mail: ismael.nicomedio@bdobrazil.com.br

Telefone: (11) 3848-5880



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

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - DI / POLÍTICA DE INVESTIMENTOS - 1 SEMESTRE/2015

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 1º SEMESTRE / 2015

Faixas de Alocação dos Recursos por Plano

Segmento			Celpa OP		Total Celpa	
	%	Valor - R\$	%	Valor - R\$	%	Valor - R\$
Renda Fixa	88,74%	128.721.405,95	88,74%	128.721.405,95		
Renda Variável	1,19%	1.723.382,92	1,19%	1.723.382,92		
Imóveis	3,76%	5.454.580,11	3,76%	5.454.580,11		
Emp. a Participantes	6,32%	9.162.465,24	6,32%	9.162.465,24		
TOTAL	100,00%	145.061.834,22	100,00%	145.061.834,22		

Segmento	Cemat BDI		Cemat OP		Total Cemat	
	%	Valor - R\$	%	Valor - R\$	%	Valor - R\$
Renda Fixa	97,55%	45.745.125,00	94,02%	175.765.947,77	94,72%	221.511.072,77
Renda Variável	1,38%	645.439,77	1,27%	2.378.141,35	1,29%	3.023.581,12
Imóveis	0,00%	-	0,00%	-	0,00%	-
Emp. a Participantes	1,08%	504.608,04	4,71%	8.808.903,36	3,98%	9.313.511,40
TOTAL	100,00%	46.895.172,81	100,00%	186.952.992,48	100,00%	233.848.165,29

Segmento	Elétricas BDI		Elétricas OP		Total Elétricas	
	%	Valor - R\$	%	Valor - R\$	%	Valor - R\$
Renda Fixa	90,23%	68.633.002,94	84,53%	110.576.997,44	86,63%	179.210.000,38
Renda Variável	1,24%	945.375,90	1,18%	1.547.402,09	1,20%	2.492.777,99
Imóveis	8,16%	6.207.874,56	7,77%	10.158.262,00	7,91%	16.366.136,56
Emp. a Participantes	0,36%	276.416,69	6,52%	8.527.823,83	4,26%	8.804.240,52
TOTAL	100,00%	76.062.670,09	100,00%	130.810.485,36	100,00%	206.873.155,45

Segmento	Plano de Benefícios "R"				Total Plano de Benefícios "R"	
	%	Valor - R\$			%	Valor - R\$
Renda Fixa	97,61%	45.951.386,83			97,61%	45.951.386,83
Renda Variável	1,22%	573.870,30			1,22%	573.870,30
Imóveis	0,00%	-			0,00%	-
Emp. a Participantes	1,18%	553.441,76			1,18%	553.441,76
TOTAL	100,00%	47.078.698,89			100,00%	47.078.698,89

Segmento	Plano de Gestão Administrativa				Total Plano de Gestão Administrativa	
	%	Valor - R\$			%	Valor - R\$
Renda Fixa	100,00%	3.093.410,08			100,00%	3.093.410,08
Renda Variável	0,00%	-			0,00%	-
Imóveis	0,00%	-			0,00%	-
Emp. a Participantes	0,00%	-			-	-
TOTAL	100,00%	3.093.410,08			100,00%	3.093.410,08

TOTAL - INVESTIMENTOS REDEPREV

635.955.264,15