

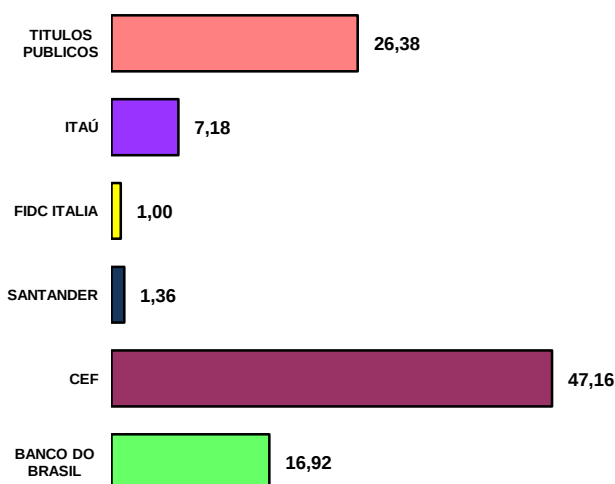
Aplicações em Fundos de Investimentos e Títulos Públicos							
SETEMBRO – 2015							
FUNDO	CNPJ	VALOR INVESTIDO	% RECURSOS	% POR ADEQUAÇÃO	IMITE P. INVES CARAGUAPREV	LIMITE RESOLUÇÃO	ADEQUAÇÃO FUNDO
BB RPPS RF IDKA2 FI	13.322.205/0001-35	11.620.017,04	5,4269	60,3481	80,0%	100,00	FI 100% Títulos TN - art. 7º, I, "b".
BB PREV RF IRF-M 1	11.328.882/0001-35	4.220.937,17	1,9713				
BB PREVID RF IMAB 5+	13.327.340/0001-73	10.258.059,10	4,7908				
BB PREV TP IPCA VII (2016, 2018, 2020, 2022)	19.523.305/0001-06	3.375.235,12	1,5763				
CEF BRASIL 2016 III TP RF	21.919.240/0001-64	28.182.392,00	13,1619				
CEF BRASIL 2020 IV TP RF	21.919.953/0001-28	38.572.760,00	18,0145				
CEF FI BRASIL IRF-M 1 1000-0	10.740.670/0001-06	5.821.927,93	2,7190				
CEF FI BRASIL IMA-B TP RF	10.740.658/0001-93	18.569.673,10	8,6725				
SANTANDER FIC IRF-M1 TIT PUBLICOS	10.979.017/0001-96	777.842,30	0,3633				
ITAU SOBERANO IRF-M 1	08.703.063/0001-16	7.818.584,69	3,6515				
BB RPPS AÇÕES GOVERNANÇA	10.418.335/0001-88	457.593,03	0,2137	0,2137	5,0%	15,00	FI em Ações - art. 8º, III.
CEF FI BRASIL REF DI LP 9999-0	03.737.206/0001-97	3.081.825,30	1,4393	12,0573	30,0%	30,00	FI de Renda Fixa - Art. 7º , IV
CEF FI BRASIL REF DI LP 1000-0	03.737.206/0001-97	6.755.239,17	3,1549				
BB RPPS RF PERFIL	13.077.418/0001-49	6.295.601,14	2,9402				
SANTANDER CORPORATE DI	03.069.104/0001-40	2.133.025,62	0,9962				
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINAMICA	21.838.150/0001-49	7.551.374,28	3,5267				
FIDC FECHADO MULTISETORIAL ITALIA	13.990.000/0001-28	2.144.601,78	1,0016	1,0016	2,5%	5,00	FI em Direitos Creditórios Fechado - art 7º, VII, "a"
FIDC ABERTO		0,00	0,0000	0,0000	10,0%	15,00	FI em Direitos Creditórios Aberto - art. 7º, VI
FI MULTIMERCADO		0,00	0,0000	0,0000	5,0%	5,00	FI Multimercado - art 8º, IV
FI RF REFERENCIADOS		0,00	0,0000	0,0000	20,0%	80,00	FI Renda Fixa Referenciados RF - Art. 7º, III
FI CREDITO PRIVADO		0,00	0,0000	0,0000	2,5%	5,00	Renda Fixa Credito Privado - art 7º, VII, "b"
FI EM PARTICIPAÇÕES		0,00	0,0000	0,0000	5,0%	5,00	FI Participações - art 8º, V
FI IMOBILIARIO COTAS		0,00	0,0000	0,0000	5,0%	5,00	FI Imobiliario - art 8º, VI
FI AÇÕES REFERENCIADOS		0,00	0,0000	0,0000	5,0%	30,00	FI Ações Referenciados -Art. 8º, I
Total em Bancos R\$		157.636.688,77	73,6206				
TITULOS PUBLICOS FEDERAIS		VALOR INVESTIDO	% RECURSOS	% POR ADEQUAÇÃO	IMITE P. INVES CARAGUAPREV	LIMITE RESOLUÇÃO	ADEQUAÇÃO FUNDO
6.470 NTN-F 2017		6.252.758,31	2,9202	26,3794	40,0%	100,0%	Títulos do Tesouro Nacional - SELIC - art. 7º, I, "a".
18.472 NTN-F 2017		17.851.769,94	8,3373				
11.295 NTN-F 2017		10.915.750,40	5,0980				
22.209 NTN-F 2017		21.463.293,55	10,0239				
Total em Títulos R\$		56.483.572,20	26,3794				
Total Geral		214.120.260,97	100,0000				

RELATÓRIO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

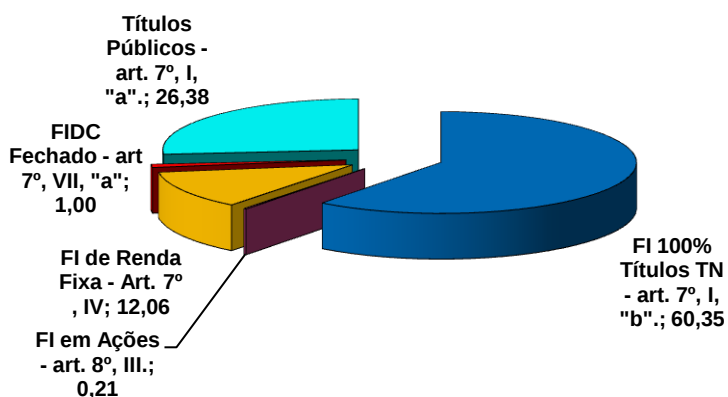
SETEMBRO DE 2015

Os recursos do CaraguaPrev são aplicados respeitando os princípios de segurança, legalidade, liquidez e eficiência. A Diretoria Executiva do CaraguaPrev, em conjunto com o Comitê de Investimentos e o Conselho Deliberativo, vem buscando estratégias para que as necessidades atuariais do Instituto sejam alcançadas de acordo com os prazos estabelecidos. Neste mês a carteira de investimentos está distribuída da seguinte forma:

Distribuição por Instituição Financeira %



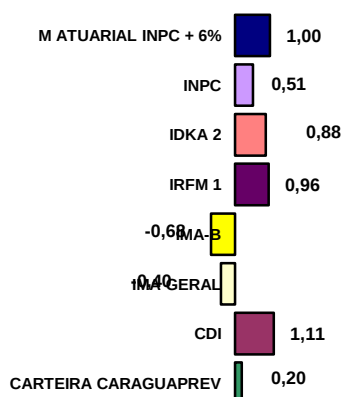
Distribuição da Carteira de Investimentos %



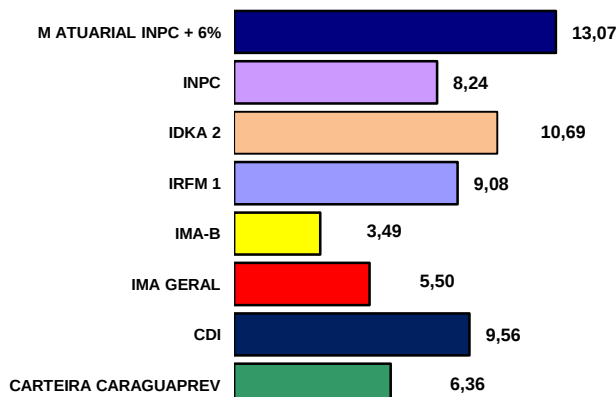
HISTORICO DA RENTABILIDADE

COMPARATIVO	NO MÊS %	NO ANO %
CARTEIRA CARAGUAPREV	0,20	6,36
CDI	1,11	9,56
IMA GERAL	-0,40	5,50
IMA-B	-0,68	3,49
IRFM 1	0,96	9,08
IDKA 2	0,88	10,69
INPC	0,51	8,24
M ATUARIAL INPC + 6%	1,00	13,07

HISTORICO DA RENTABILIDADE MENSAL



HISTORICO DA RENTABILIDADE ANUAL



SETEMBRO DE 2015

	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	RENDIMENTOS	SALDO FINAL	RENTABILIDADE MENSAL %	RENABILIDADE NO ANO %	RENTABILIDADE CARTEIRA %
BANCO BRASIL IDKA2	11.518.747,40	0,00	0,00	101.269,64	11.620.017,04	0,8791	9,673	0,047295683
BANCO BRASIL PREV RF IMAB 5+	10.447.591,78	0,00	0,00	-189.532,68	10.258.059,10	-1,8141	0,3019	-0,088516929
BB PREV RF IRF-M 1	4.183.729,73	0,00	0,00	37.207,44	4.220.937,17	0,8893	8,7313	0,017376889
BB PREV RF PERFIL DI	4.127.094,46	2.105.367,86	0,00	63.138,82	6.295.601,14	1,1216	9,7381	0,02948755
BB AÇÕES GOVERNANÇA	466.074,40	0,00	0,00	-8.481,37	457.593,03	-1,8197	-8,6754	-0,003961031
BB PREV TP IPCA VII	3.349.163,98	0,00	0,00	26.071,14	3.375.235,12	0,7748	5,8018	0,012175933
CEF BRASIL 2020 IV TP RF	38.592.400,00	0,00	0,00	-19.640,00	38.572.760,00	-0,05	-0,52	-0,00917242
CEF BRASIL 2016 III TP RF	27.764.912,00	0,00	0,00	417.480,00	28.182.392,00	1,5	3,65	0,19497454
CEF FI BR DI LP 9999-0	3.153.590,30	0,00	106.756,00	34.991,00	3.081.825,30	1,1188	9,6364	0,016341751
CEF BRASIL IRF-M1 1000-0	6.383.625,75	125.134,21	746.463,20	59.631,17	5.821.927,93	0,9498	8,8926	0,027849382
CEF BRASIL IMA-B TP RF 1000-0	18.774.251,34	0,00	0,00	-204.578,24	18.569.673,10	-1,0897	2,2755	-0,095543616
CEF FI BR DI LP 1000-0	6.680.491,68	0,00	0,00	74.747,49	6.755.239,17	1,1188	9,6364	0,034909116
SANTANDER CORPORATE DI	2.109.562,68	0,00	0,00	23.462,94	2.133.025,62	1,1122	9,285	0,010957833
SANTANDER IRF-M1 TP	770.910,11	0,00	0,00	6.932,19	777.842,30	0,8992	8,4483	0,003237522
FIDC MULTISETOR ITALIA	2.190.406,97	0,00	51.826,51	6.021,32	2.144.601,78	0,2748	48,6418	0,002812121
ITAU SOBERANO IRFM 1	7.753.300,18	0,00	0,00	65.284,51	7.818.584,69	0,84	8,86	0,030489646
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINAMIC	7.503.186,89	0,00	0,00	48.187,39	7.551.374,28	0,64	2,48	0,022504825
NTNF 2017 - 22/03/2007	6.266.527,18	0,00	0,00	-13.768,87	6.252.758,31	-0,2197	6,3622	-0,006430438
NTNF 2017 - 08/05/2009	17.891.080,38	0,00	0,00	-39.310,44	17.851.769,94	-0,2197	6,3622	-0,018359047
NTNF 2017 - 28/08/2009	10.939.787,40	0,00	0,00	-24.037,00	10.915.750,40	-0,2197	6,3622	-0,011225934
NTNF 2017 - 30/12/2009	21.510.556,75	0,00	0,00	-47.263,20	21.463.293,55	-0,2197	6,3622	-0,022073203
Total Geral	212.376.991,36	2.230.502,07	905.045,71	417.813,25	214.120.260,97			0,19513018

Aplicações em Fundos de Investimentos e Títulos Públicos
SETEMBRO – 2015

Bancos	Valores (R\$)	% Aplicada em cada Fundo
BANCO DO BRASIL	36.227.442,60	16,9192
CAIXA ECON. FEDERAL	100.983.817,50	47,1622
BANCO SANTANDER	2.910.867,92	1,3595
FIDC ITÁLIA	2.144.601,78	1,0016
BANCO ITAU UNIBANCO S.A	15.369.958,97	7,1782

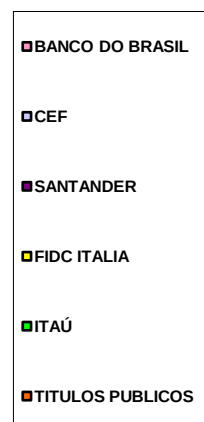
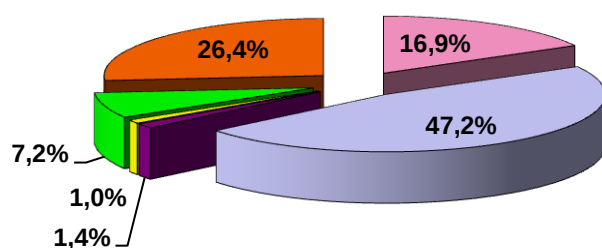
Total em Bancos R\$	157.636.688,77	73,6206
----------------------------	-----------------------	----------------

Títulos Públicos Federais	Valores (R\$)	% Aplicada em cada Título
6.470 NTN-F 2017	6.252.758,31	2,9202
18.472 NTN-F 2017	17.851.769,94	8,3373
11.295 NTN-F 2017	10.915.750,40	5,0980
22.209 NTN-F 2017	21.463.293,55	10,0239

Total em Títulos R\$	56.483.572,20	26,3794
-----------------------------	----------------------	----------------

Total Geral	214.120.260,97	100,0000
--------------------	-----------------------	-----------------

RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA
--



MÉDIA DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS 2015

	% JANEIRO	% FEVEREIRO	% MARÇO	% ABRIL	% MAIO	% JUNHO	% JULHO	% AGOSTO	% SETEMBRO	% OUTUBRO	% NOVEMBRO	% DEZEMBRO	RENTABILIDADE NO ANO %
BANCO BRASIL IDKA2	1,9365	1,2121	0,9449	0,279	1,8433	0,8423	1,7386	-0,3723	0,8791				9,673
BANCO BRASIL PREV RF IMAB 5+	3,6162	0,2461	-1,0422	3,7154	3,206	-0,7268	-1,9015	-4,6606	-1,8141				0,3019
BB PREV RF IRF-M 1	0,9958	0,7124	0,8856	0,8597	0,9127	0,9099	1,2537	0,9914	0,8893				8,7313
BB PREV RF PERFIL DI	0,9406	0,832	1,0434	0,9722	1,0322	1,0884	1,1964	1,1139	1,1216				9,7381
BB AÇÕES GOVERNANÇA	-6,2857	7,8684	0,4111	6,3631	-4,2046	0,5272	-2,4585	-6,9827	-1,8197				-8,6754
BB PREV TP IPCA VII						0,5688	1,49	-0,8013	0,7784				5,8018
CEF BRASIL 2020 VI TP RF							1,31	-1,76	-0,05				-0,52
CEF BRASIL 2016 III TP RF						0,0200	1,42	0,71	1,5				3,65
CEF FI BR DI LP 9999-0	0,9287	0,8302	1,0352	0,9653	0,9804	1,0691	1,1906	1,1288	1,1188				9,6364
CEF BRASIL IRF-M1 1000-0	1,0487	0,7167	0,8921	0,8507	0,9238	0,9079	1,2646	1,0056	0,9498				8,8926
CEF BRASIL IMA-B TP RF 1000-0	3,0543	0,5072	-0,3155	2,4248	2,528	-0,4267	-0,8605	-3,3944	-1,0897				2,2755
CEF FI BR DI LP 1000-0	0,9287	0,8302	1,0352	0,9653	0,9804	1,0691	1,1906	1,1288	1,1188				9,6364
SANTANDER CORPORATE DI	0,9357	0,8326	1,0556	0,9557	0,9938	1,0784	1,2008	1,1202	1,1122				9,285
SANTANDER IRF-M1 TP	1,0467	0,7038	0,8679	0,843	0,9525	0,8953	1,2399	0,993	0,8992				8,4483
FIDC MULTISETOR ITALIA	1,22	1,32	2,04	3,055	0,64	1,0764	37,9056	1,1107	0,2748				48,6418
ITAU SOBERANO IRFM 1	1,11	0,66	0,9067	0,96	0,8652	0,8799	1,26	1,05	0,84				8,86
ITAU ALOCAÇÃO DINAMICA							-0,12	0,16	0,64				2,48
NTNF 2017	1,6759	0,3792	0,225	0,8749	1,2435	0,2905	1,7179	0,1740	-0,2197				6,3622
Rentabilidade da carteira%	1,36%	0,65%	0,65%	1,02%	1,07%	0,52%	1,53%	-0,61%	0,20%				6,38%
Meta Atuarial (INPC+6%a.a)	1,97%	1,58%	2,03%	1,18%	1,46%	1,26%	1,12%	0,74%	1,00%				12,34%
Atingimento mensal %	68,68%	41,06%	32,16%	86,72%	74,38%	50,25%	139,34%	-82,25%	19,57%				
Atingimento Meta acumulado %			47,11%	53,77%	57,15%	55,96%	64,57%	54,66%	51,57%				