

Aplicações em Fundos de Investimentos e Títulos Públicos							
OUTUBRO – 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	11.933.450,85	5,4433	59,9174	80,0%	100,00	FI 100% Títulos TN - art. 7º, I, "b".
BB PREV RF IRF-M 1	11.328.882/0001-35	4.275.775,55	1,9503				
BB PREVID RF IMAB 5+	13.327.340/0001-73	10.527.437,73	4,8019				
BB PREV TP IPCA VII (2016, 2018, 2020, 2022)	19.523.305/0001-06	3.451.390,54	1,5743				
CEF BRASIL 2016 III TP RF	21.919.240/0001-64	28.761.432,00	13,1191				
CEF BRASIL 2020 IV TP RF	21.919.953/0001-28	39.428.920,00	17,9850				
CEF FI BRASIL IRF-M 1 1000-0	10.740.670/0001-06	5.264.360,03	2,4013				
CEF FI BRASIL IMA-B TP RF	10.740.658/0001-93	19.003.402,79	8,6681				
SANTANDER FIC IRF-M1 TIT PUBLICOS	10.979.017/0001-96	787.912,26	0,3594				
ITAU SOBERANO IRF-M 1	08.703.063/0001-16	7.924.456,25	3,6146				
BB RPPS AÇÕES GOVERNANÇA	10.418.335/0001-88	462.600,86	0,2110	0,2110	5,0%	15,00	FI em Ações - art. 8º, III.
CEF FI BRASIL REF DI LP 9999-0	03.737.206/0001-97	3.035.127,07	1,3844	12,7913	30,0%	30,00	FI de Renda Fixa - Art. 7º , IV
CEF FI BRASIL REF DI LP 1000-0	03.737.206/0001-97	6.830.374,20	3,1156				
BB RPPS RF PERFIL	13.077.418/0001-49	8.382.720,46	3,8237				
SANTANDER CORPORATE DI	03.069.104/0001-40	2.156.550,18	0,9837				
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINAMICA	21.838.150/0001-49	7.638.043,93	3,4840				
FIDC FECHADO MULTISSETORIAL ITALIA	13.990.000/0001-28	2.125.400,48	0,9695	0,9695	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\$		161.989.355,18	73,8892
---------------------	--	----------------	---------

TITULOS PUBLICOS FEDERAIS		VALOR INVESTIDO	% RECURSOS	% POR ADEQUAÇÃO	IMITE P. INVES CARAGUAPREV	LIMITE RESOLUÇÃO	ADEQUAÇÃO FUNDO
6.470 NTN-F 2017		6.336.877,01	2,8905	26,1108	40,0%	100,0%	Títulos do Tesouro Nacional - SELIC - art. 7º, I, "a".
18.472 NTN-F 2017		18.091.930,80	8,2524				
11.295 NTN-F 2017		11.062.600,60	5,0461				
22.209 NTN-F 2017		21.752.040,45	9,9219				

Total em Títulos R\$		57.243.448,86	26,1108
----------------------	--	---------------	---------

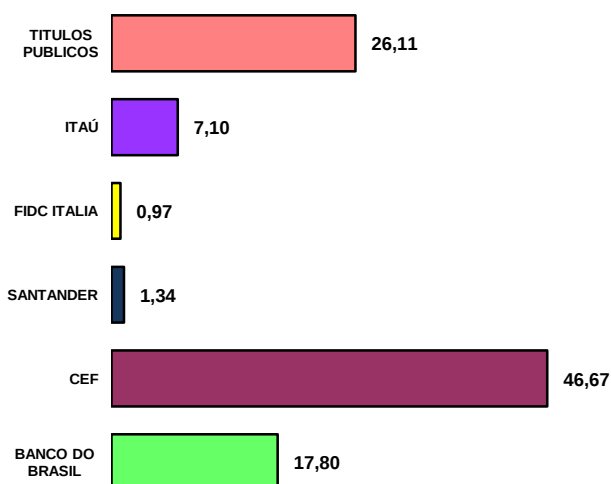
Total Geral		219.232.804,04	100,0000
-------------	--	----------------	----------

RELATÓRIO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

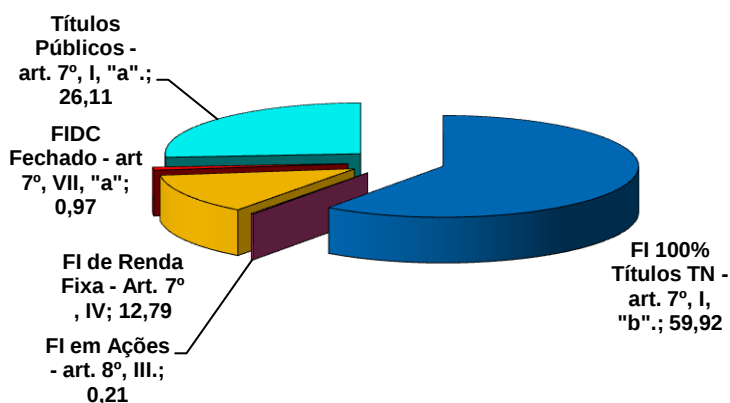
OUTUBRO DE 2015

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 %



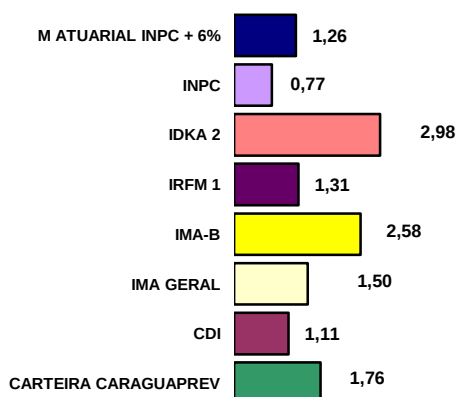
Distribuição da Carteira de Investimentos %



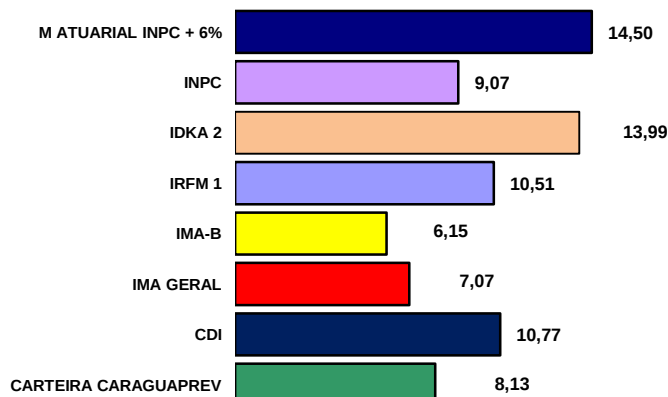
HISTORICO DA RENTABILIDADE

COMPARATIVO	NO MÊS %	NO ANO %
CARTEIRA CARAGUAPREV	1,76	8,13
CDI	1,11	10,77
IMA GERAL	1,50	7,07
IMA-B	2,58	6,15
IRFM 1	1,31	10,51
IDKA 2	2,98	13,99
INPC	0,77	9,07
M ATUARIAL INPC + 6%	1,26	14,5

HISTORICO DA RENTABILIDADE MENSAL



HISTORICO DA RENTABILIDADE ANUAL



OUTUBRO DE 2015

	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	RENDIMENTOS	SALDO FINAL	RENTABILIDADE MENSAL %	RENABILIDADE NO ANO %	RENTABILIDADE CARTEIRA %
BANCO BRASIL IDKA2	11.620.017,04	0,00	0,00	313.433,81	11.933.450,85	2,6973	12,6313	0,142968481
BANCO BRASIL PREV RF IMAB 5+	10.258.059,10	0,00	0,00	269.378,63	10.527.437,73	2,626	2,9358	0,122873322
BB PREV RF IRF-M 1	4.220.937,17	0,00	0,00	54.838,38	4.275.775,55	1,2991	10,1439	0,025013766
BB PREV RF PERFIL DI	6.295.601,14	2.001.042,64	0,00	86.076,68	8.382.720,46	1,1179	10,9649	0,039262683
BB AÇÕES GOVERNANÇA	457.593,03	0,00	0,00	5.007,83	462.600,86	1,09443	-7,676	0,002284252
BB PREV TP IPCA VII	3.375.235,12	0,00	0,00	76.155,42	3.451.390,54	2,2562	8,189	0,034737238
CEF BRASIL 2020 IV TP RF	38.572.760,00	0,00	0,00	856.160,00	39.428.920,00	2,22	1,62	0,39052550
CEF BRASIL 2016 III TP RF	28.182.392,00	0,00	0,00	579.040,00	28.761.432,00	2,05	5,71	0,26412106
CEF FI BR DI LP 9999-0	3.081.825,30	0,00	80.743,39	34.045,16	3.035.127,07	1,1122	10,8558	0,015529227
CEF BRASIL IRF-M1 1000-0	5.821.927,93	113.126,40	745.896,31	75.202,01	5.264.360,03	1,2962	10,3041	0,034302353
CEF BRASIL IMA-B TP RF 1000-0	18.569.673,10	0,00	0,00	433.729,69	19.003.402,79	2,3357	4,6644	0,197839777
CEF FI BR DI LP 1000-0	6.755.239,17	0,00	0,00	75.135,03	6.830.374,20	1,1122	10,8558	0,034271801
SANTANDER CORPORATE DI	2.133.025,62	0,00	0,00	23.524,56	2.156.550,18	1,1028	10,3878	0,010730401
SANTANDER IRF-M1 TP	777.842,30	0,00	0,00	10.069,96	787.912,26	1,2946	9,7429	0,004593272
FIDC MULTISETOR ITALIA	2.144.601,78	0,00	39.805,58	20.604,28	2.125.400,48	0,9957	63,3071	0,009398356
ITAU SOBERANO IRFM 1	7.818.584,69	0,00	0,00	105.871,56	7.924.456,25	1,35	10,33	0,048291842
ITAU INSTIT ALOCAÇÃO DINAMIC	7.551.374,28	0,00	0,00	86.669,65	7.638.043,93	1,15	3,66	0,039533158
NTNF 2017 - 22/03/2007	6.252.758,31	0,00	0,00	84.118,70	6.336.877,01	1,3453	7,7075	0,038369577
NTNF 2017 - 08/05/2009	17.851.769,94	0,00	0,00	240.160,86	18.091.930,80	1,3453	7,7075	0,109546042
NTNF 2017 - 28/08/2009	10.915.750,40	0,00	0,00	146.850,20	11.062.600,60	1,3453	7,7075	0,066983680
NTNF 2017 - 30/12/2009	21.463.293,55	0,00	0,00	288.746,90	21.752.040,45	1,3453	7,7075	0,131707890
Total Geral	214.120.260,97	2.114.169,04	866.445,28	3.864.819,31	219.232.804,04			1,762883674

Aplicações em Fundos de Investimentos e Títulos Públicos
OUTUBRO – 2015

Bancos	Valores (R\$)	% Aplicada em cada Fundo
BANCO DO BRASIL	39.033.375,99	17,8045
CAIXA ECON. FEDERAL	102.323.616,09	46,6735
BANCO SANTANDER	2.944.462,44	1,3431
FIDC ITÁLIA	2.125.400,48	0,9695
BANCO ITAU UNIBANCO S.A	15.562.500,18	7,0986

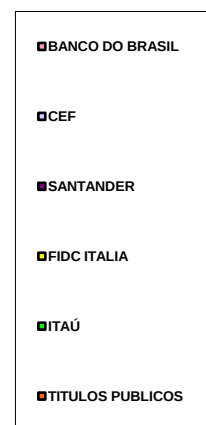
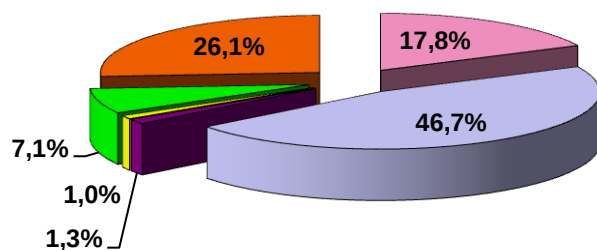
Total em Bancos R\$	161.989.355,18	73,8892
----------------------------	-----------------------	----------------

Títulos Públicos Federais	Valores (R\$)	% Aplicada em cada Título
6.470 NTN-F 2017	6.336.877,01	2,8905
18.472 NTN-F 2017	18.091.930,80	8,2524
11.295 NTN-F 2017	11.062.600,60	5,0461
22.209 NTN-F 2017	21.752.040,45	9,9219

Total em Títulos R\$	57.243.448,86	26,1108
-----------------------------	----------------------	----------------

Total Geral	219.232.804,04	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	2,6973			12,6313
BANCO BRASIL PREV RF IMAB 5+	3,6162	0,2461	-1,0422	3,7154	3,206	-0,7268	-1,9015	-4,6606	-1,8141	2,626			2,9358
BB PREV RF IRF-M 1	0,9958	0,7124	0,8856	0,8597	0,9127	0,9099	1,2537	0,9914	0,8893	1,2991			10,1439
BB PREV RF PERFIL DI	0,9406	0,832	1,0434	0,9722	1,0322	1,0884	1,1964	1,1139	1,1216	1,1179			10,9649
BB AÇÕES GOVERNANÇA	-6,2857	7,8684	0,4111	6,3631	-4,2046	0,5272	-2,4585	-6,9827	-1,8197	1,0943			-7,676
BB PREV TP IPCA VII						0,5688	1,49	-0,8013	0,7784	2,2562			8,189
CEF BRASIL 2020 VI TP RF							1,31	-1,76	-0,05	2,22			1,62
CEF BRASIL 2016 III TP RF						0,0200	1,42	0,71	1,5	2,05			5,71
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	1,1122			10,8558
CEF BRASIL IRF-M1 1000-0	1,0487	0,7167	0,8921	0,8507	0,9238	0,9079	1,2646	1,0056	0,9498	1,2962			10,3041
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	2,3357			4,6644
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	1,1122			10,8558
SANTANDER CORPORATE DI	0,9357	0,8326	1,0556	0,9557	0,9938	1,0784	1,2008	1,1202	1,1122	1,1028			10,3878
SANTANDER IRF-M1 TP	1,0467	0,7038	0,8679	0,843	0,9525	0,8953	1,2399	0,993	0,8992	1,2946			9,7429
FIDC MULTISETOR ITALIA	1,22	1,32	2,04	3,15	0,64	1,04	45,11	1,13	0,38	0,9957			63,3071
ITAU SOBERANO IRFM 1	1,11	0,66	0,9067	0,96	0,8652	0,8799	1,26	1,05	0,84	1,35			10,33
ITAU ALOCAÇÃO DINAMICA							-0,12	0,16	0,64	1,15			3,66
NTNF 2017	1,6759	0,3792	0,225	0,8749	1,2435	0,2905	1,7179	0,1740	-0,2197	1,3453			7,7075
Rentabilidade da carteira%	1,36%	0,65%	0,65%	1,02%	1,07%	0,52%	1,53%	-0,61%	0,20%	1,79%			8,17%
Meta Atuarial (INPC+6%a.a)	1,97%	1,58%	2,03%	1,18%	1,46%	1,26%	1,12%	0,74%	1,00%	1,26%			13,60%
Atingimento mensal %	68,68%	41,06%	32,16%	86,72%	74,38%	50,25%	139,34%	-82,25%	19,57%	142,37			
Atingimento Meta acumulado %			47,11%	53,77%	57,15%	55,96%	64,57%	54,66%	51,57%	59,74%			