

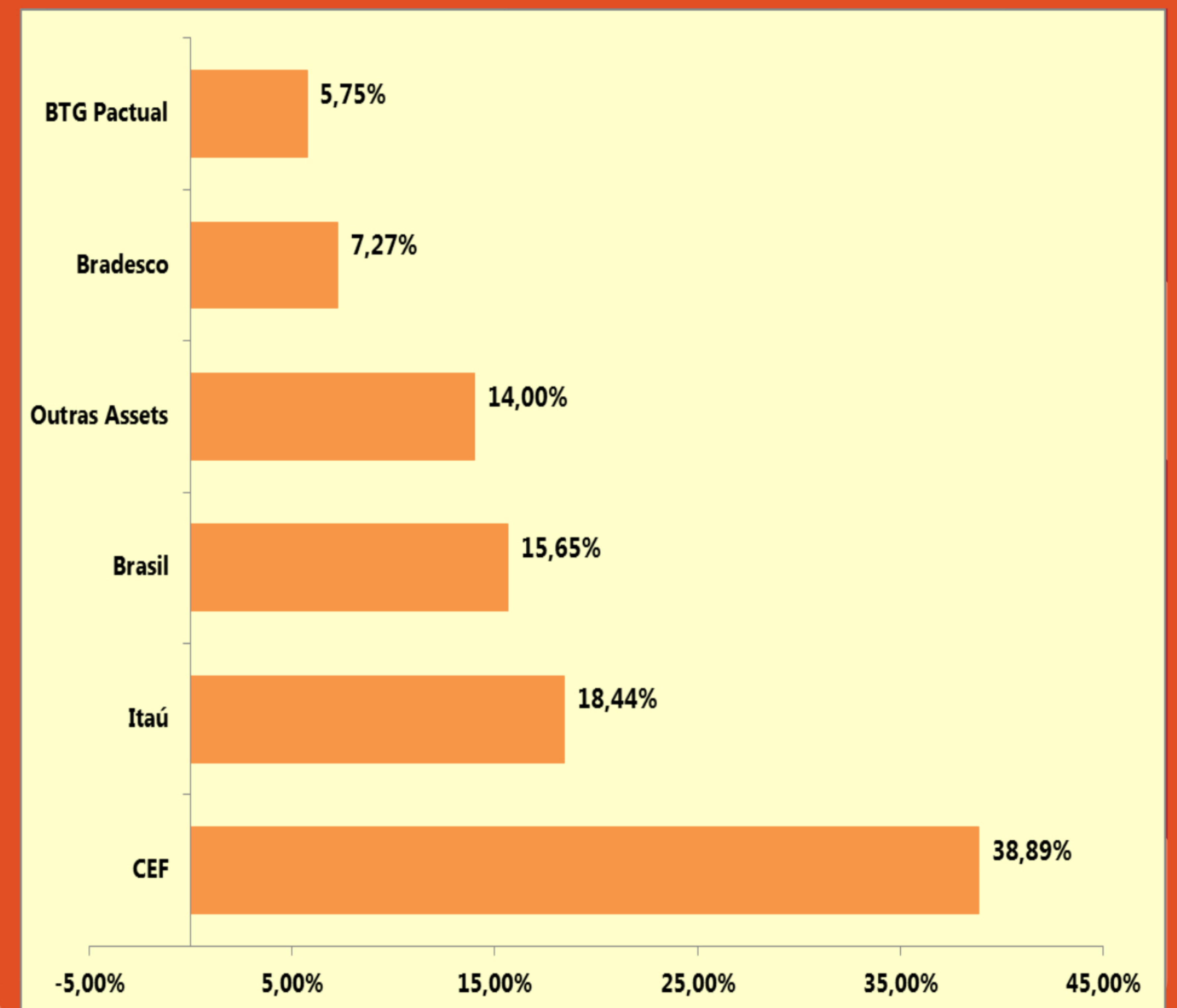
COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - SETEMBRO DE 2019

R
E
N
D
A

F
I
X
A

ATIVOS	VALOR APLICADO	%
ARTIGO 7º I A - TÍTULOS PÚBLICOS TESOIRO NACIONAL - LIMITE DE APLICAÇÃO: 100%		
NTN-B 2110 - Títulos Públicos 2024	7.941.636,52	0,62%
NTN-B 3055 - Títulos Públicos 2024	11.498.435,81	0,90%
NTN-B 1709 - Títulos Públicos 2022	6.188.641,18	0,48%
NTN-B 3405 - Títulos Públicos 2024	12.815.768,89	1,00%
NTN-B 1698 - Títulos Públicos 2020	5.749.675,91	0,45%
NTN-F 10.000 Títulos Públicos 2023	11.370.621,70	0,89%
	55.564.780,01	4,33%
ARTIGO 7º I B - FI 100% TÍTULOS PÚBLICOS - LIMITE DE APLICAÇÃO: 100%		
BB PREVID TP VII	38.148.600,73	2,97%
BB PREVID TP IPCA III	65.817.958,81	5,13%
CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	115.758.576,41	9,02%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	65.898.790,04	5,14%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	99.431.607,46	7,75%
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	93.875.932,68	7,32%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	29.591.729,41	2,31%
FI CAIXA BRASIL 2024 V TP RF	29.491.800,00	2,30%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.711.532,27	0,29%
	541.726.527,82	42,22%
ARTIGO 7º IV A - FI de Renda Fixa - Geral - LIMITE DE APLICAÇÃO: 40%		
BB PREVID RF FLUXO	30.617.273,28	2,39%
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B5	42.699.369,76	3,33%
BRANCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	9.441.580,22	0,74%
ITAÚ I ALOCAÇÃO DINÂMICA	172.344.293,82	13,43%
	255.102.517,08	19,88%
ARTIGO 7º VII A - FIDC FECHADO COTA SÊNIOR - LIMITE DE APLICAÇÃO: 5%		
FIDC GGR PRIME I	16.525.860,50	1,29%
FIDC MASTER III	2.537,96	0,00%
FIDC PREMIUM-SR	2.527.196,68	0,1970%
	19.055.595,13	1,49%
ARTIGO 7º VII B - FI RENDA FIXA "CRÉDITO PRIVADO" - LIMITE DE APLICAÇÃO: 5%		
BB PREVID IPCA III	10.696.633,92	0,83%
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CP	6.420.675,18	0,50%
	17.117.309,10	1,33%
TOTAL DA RENDA FIXA:	888.566.729,14	69,26%

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - SETEMBRO DE 2019

RENDAMENTOS

ATIVOS VALOR APLICADO %

ARTIGO 7º I A - TÍTULOS PÚBLICOS TESOIRO NACIONAL - LIMITE DE APLICAÇÃO: 100%

NTN-B 2110 - Títulos Públicos 2024	7.941.636,52	0,62%
NTN-B 3055 - Títulos Públicos 2024	11.498.435,81	0,90%
NTN-B 1709 - Títulos Públicos 2022	6.188.641,18	0,48%
NTN-B 3405 - Títulos Públicos 2024	12.815.768,89	1,00%
NTN-B 1698 - Títulos Públicos 2020	5.749.675,91	0,45%
NTN-F 10.000 Títulos Públicos 2023	11.370.621,70	0,89%
	55.564.780,01	4,33%

ARTIGO 7º I B - FI 100% TÍTULOS PÚBLICOS - LIMITE DE APLICAÇÃO: 100%

BB PREVID TP VII	38.148.600,73	2,97%
BB PREVID TP IPCA III	65.817.958,81	5,13%
CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	115.758.576,41	9,02%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	65.898.790,04	5,14%
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	99.431.607,46	7,75%
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	93.875.932,68	7,32%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	29.591.729,41	2,31%
FI CAIXA BRASIL 2024 V TP RF	29.491.800,00	2,30%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.711.532,27	0,29%
	541.726.527,82	42,22%

7º IV A - FI de Renda Fixa - Geral - LIMITE DE APLICAÇÃO: 40%

BB PREVID RF FLUXO	30.617.273,28	2,39%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B5	42.699.369,76	3,33%
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	9.441.580,22	0,74%
ITAÚ I ALOCAÇÃO DINÂMICA	172.344.293,82	13,43%
	255.102.517,08	19,88%

ARTIGO 7º VII A - FIDC FECHADO COTA SÊNIOR - LIMITE DE APLICAÇÃO: 5%

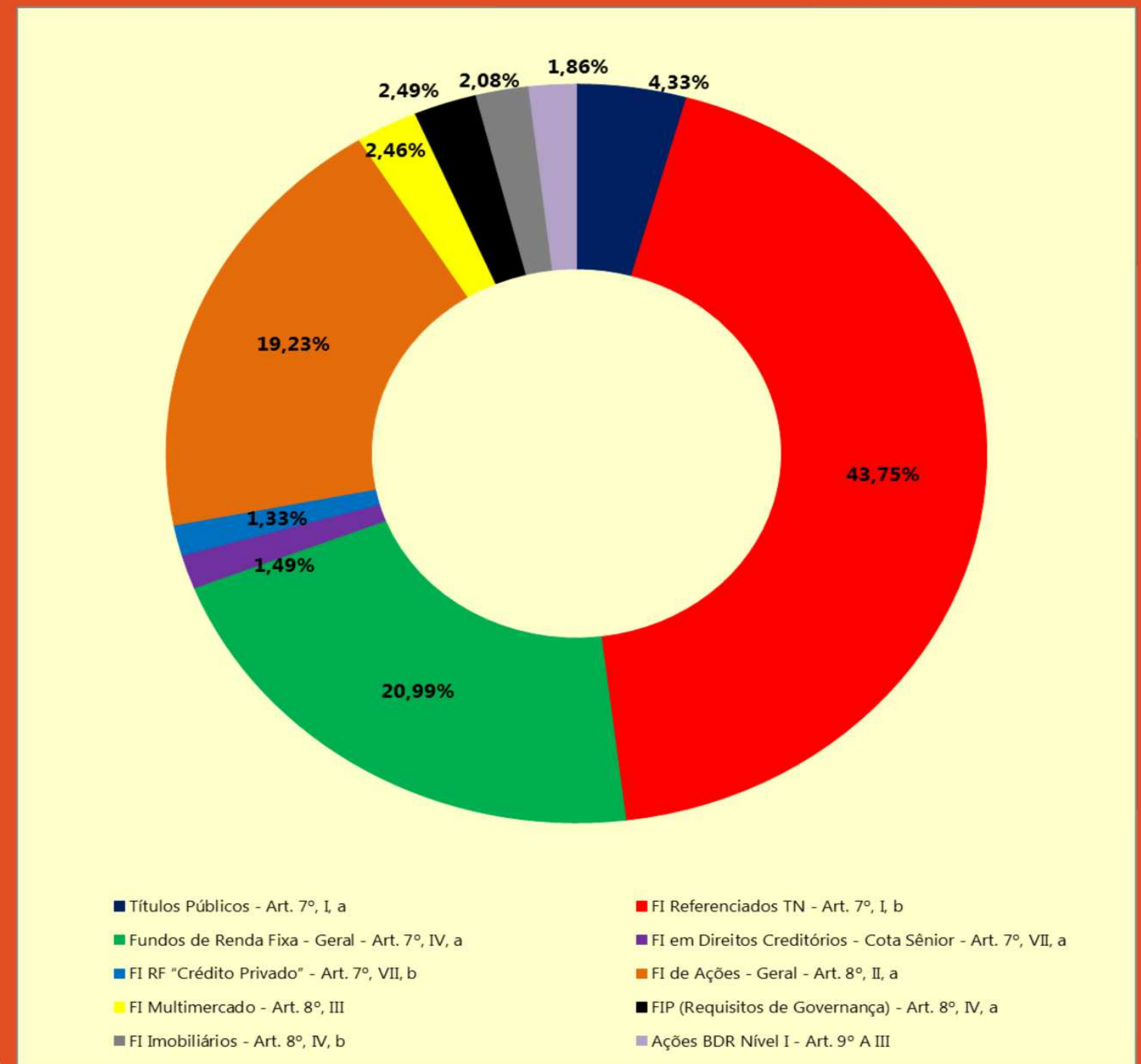
FIDC GGR PRIME I	16.525.860,50	1,29%
FIDC MASTER III	2.537,96	0,00%
FIDC PREMIUM-SR	2.527.196,68	0,1970%
	19.055.595,13	1,49%

ARTIGO 7º VII B - FI RENDA FIXA "CRÉDITO PRIVADO" - LIMITE DE APLICAÇÃO: 5%

BB PREVID IPCA III	10.696.633,92	0,83%
FI CAIXA BRASIL IPCA XVI RF CP	6.420.675,18	0,50%
	17.117.309,10	1,33%

TOTAL DA RENDA FIXA:	888.566.729,14	69,26%
-----------------------------	-----------------------	---------------

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ENQUADRAMENTO DA LEI 3.922/2010



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - SETEMBRO DE 2019

ATIVOS VALOR APLICADO %

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

ARTIGO 9º A - III - FUNDO DE AÇÕES BDR - NÍVEL I

FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	23.803.468,49	1,86%
	23.803.468,49	1,86%

FUNDO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

ARTIGO 7º IV A - FI de Renda Fixa - Geral - LIMITE DE APLICAÇÃO: 40%

CAIXA FI BRASIL REF DI LP	14.226.117,39	1,11%
	14.226.117,39	1,11%

FUNDO DE CONSTRUÇÃO DA SEDE DO IPREMB

ARTIGO 7º I B - FI 100% TÍTULOS PÚBLICOS - LIMITE DE APLICAÇÃO: 100%

CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF - CONTA 132-5	19.564.686,30	1,52%
---	---------------	-------

INVESTIMENTOS	1.249.227.830,88	97,37%
---------------	------------------	--------

TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	14.226.117,39	1,11%
-----------------------	---------------	-------

FUNDO DE CONSTRUÇÃO DA SEDE DO IPREMB	19.564.686,30	1,52%
---------------------------------------	---------------	-------

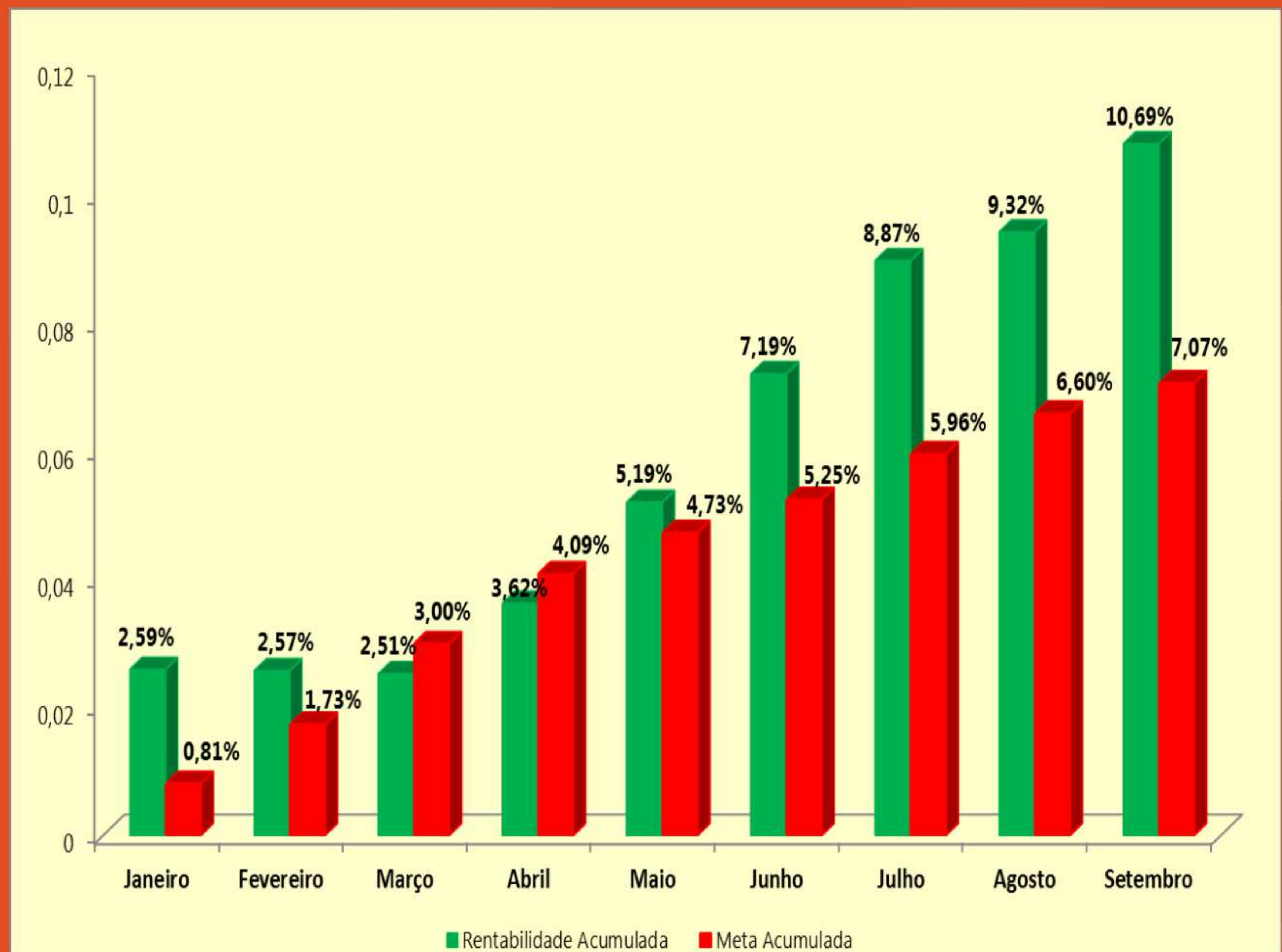
TOTAL DA CARTEIRA:	1.283.018.634,57	100,00%
---------------------------	-------------------------	----------------

CONTAS CORRENTE	2.188.489,66	
-----------------	--------------	--

TOTAL:	1.285.207.124,23	
---------------	-------------------------	--

	MÊS - SETEMBRO	ANO 2019
META ATUARIAL	0,45%	7,07%
RENTABILIDADE CARTEIRA IPREMB	1,26%	10,69%

RENTABILIDADE X META - ACUMULADAS



COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA - SETEMBRO DE 2019

Nota: *Brasil Florestal FIP: Na carteira de investimentos do mês de Setembro/2019, a Divisão de Investimentos promoveu a alteração da denominação do fundo ATICO FLORESTAL FIP para BRASIL FLORESTAL FIP, conforme nova denominação apresentada no site da Comissão de Valores Mobiliários.

**Em 04 de outubro de 2019 após o recebimento do extrato do mês de Setembro/2019 e assim ter sido apurado uma considerável divergência nos valores do fundo em comento pela Divisão de Investimentos, fomos informados, inicialmente que O FIP MULTISTRATÉGIA CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA teve seus extratos dos meses de Julho e Agosto reprocessados. Após o questionamento à GEICO, foram enviados os extratos e posições consolidadas nas datas bases 31.07.2019 e 30.08.2019. Fomos informados que se tratou de uma reprecificação de ativos. Ademais, no dia 09 de outubro foi encaminhado aos cotistas um comunicado nos seguintes dizeres: "A carteira do FIP MULTISTRATÉGIA CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA foi reprocessada, desde 28/03/2018, para melhor refletir o valor justo dos ativos, apurado por meio de laudo de avaliação elaborado por empresa especializada independente. Durante os trabalhos de auditoria das demonstrações financeiras do fundo relativas ao exercício social findo em 31/03/2018, houve apontamentos dos auditores independentes com relação ao valor dos ativos do fundo, em especial em função dos impactos decorrentes da crise econômica. A fim de mitigar o risco de ressalvas no parecer dos auditores sobre as demonstrações financeiras do fundo, a CAIXA, na qualidade de administradora e gestora do FIP MULTISTRATÉGIA CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA, buscou esclarecer todos os questionamentos realizados, bem como promover todos os ajustes necessários para que o valor dos ativos refletisse a melhor estima de valor justos dos mesmos. Tais trâmites culminaram na necessidade de reprocessamento das carteiras e extratos no período informado, para que todos os ajustes necessários fossem realizados". Ressaltamos que o devido acerto da carteira foi realizado no fechamento de Setembro/2019, retificando assim, a cota do referido fundo, a rentabilidade final da carteira de Setembro/2019 e o Patrimônio Líquido correspondente a esse mesmo mês. Desta forma, houve também alterações nos valores cumulativos contantes nas planilhas e relatórios emitidos após essa ocorrência.