

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
2º TRIMESTRE DE 2023

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2023		2022		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	193.631.964,99	88,51%	218.575.184,89	89,45%	Até 100%
Renda Variável	-	-	25.792.252,10	10,55%	Até 15%
Estruturado	25.122.187,15	11,48%	-	-	Até 15%
Exterior	-	-	-	-	-
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes (*)	-	-	-	-	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	10.233,68	0,00%	325,33	0,00%	-
Total de Investimentos	218.764.385,82	100,00%	244.367.762,32	100,00%	-

(*) De acordo com a Resolução Normativa ANS Nº 392/2015, o segmento de operações com participantes não é classificado como "ativos garantidores" (Investimentos). Portanto, a partir de junho/2019 não consideramos mais esse segmento como parte integrante da carteira de investimentos dos Fundos Assistenciais.

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	1,60%	IMA	8,64%
Estruturados	1,34%	IHFA	4,01%
Total	1,03%	Taxa Selic	6,50%

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
RENDA FIXA		119.762.331,99	54,74%
Fundos Exclusivos		119.762.331,99	54,74%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	119.762.331,99	54,74%
ESTRUTURADOS		25.122.187,15	11,48%
Estruturados		25.122.187,15	11,48%
FOF FRG FIC FIM	Real Grandeza	25.122.187,15	11,48%
Total		144.884.519,14	-

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			218.764.385,82	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			119.762.327,63	54,74%
RENDA FIXA			119.755.144,88	54,74%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			119.755.144,88	54,74%
Notas do Tesouro Nacional			19.781.546,11	9,04%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			19.781.546,11	9,04%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		149	660.797,04	0,30%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2025)		287	1.192.644,25	0,55%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)		243	1.010.637,07	0,46%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	16.917.467,75	7,73%
Operações Compromissadas (Adelic)		7.494	99.973.599	45,70%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			7.182,75	0,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			99.002.058,19	45,26%
RENDA FIXA			73.876.820,11	33,77%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			73.876.820,11	33,77%
Notas do Tesouro Nacional			73.876.820,11	33,77%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			73.876.820,11	33,77%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	34.250.393,94	15,66%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	39.626.426,17	18,11%
ESTRUTURADO			25.122.187,15	11,48%
FOF FRG FIC FIM		247.888	25.122.187,15	11,48%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			3.050,93	0,00%