

**FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS**  
**DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS**  
**3º TRIMESTRE DE 2021**

**DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO**

Segmento	2021		2020		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	224.284.668,95	92,39%	152.954.633,07	100,00%	Até 100%
Renda Variável	18.492.627,44	7,62%	-	-	Até 10%
Estruturado	-	-	-	-	-
Exterior	-	-	-	-	-
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes (*)	-	-	-	-	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(8.046,39)	0,00%	(2.191,96)	0,00%	-
<b>Total de Investimentos</b>	<b>242.769.250,00</b>	<b>100,00%</b>	<b>152.952.441,11</b>	<b>100,00%</b>	<b>-</b>

(\*) 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	6,61%	Taxa Selic	2,45%
Renda Variável (*)	-	Ibovespa	-
<b>Total</b>	<b>6,24%</b>	<b>Taxa Selic</b>	<b>2,45%</b>

(\*) O Fundo de Índice "ETF - BOVA11" foi adquirido em 01/03/2021, entrando na carteira em D+2 (03/03/2021).

**RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS**

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
<b>RENDA FIXA</b>		<b>141.370.689,05</b>	<b>58,23%</b>
<b>Fundos Exclusivos</b>		<b>141.370.689,05</b>	<b>58,23%</b>
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	141.370.689,05	58,23%
<b>RENDA VARIÁVEL</b>		<b>18.492.627,44</b>	<b>7,62%</b>
<b>Fundo de Índice - ETF</b>		<b>18.492.627,44</b>	<b>7,62%</b>
Ishares BOVA11	Black Rock Brasil	18.492.627,44	7,62%
<b>Total</b>		<b>159.863.316,49</b>	<b>-</b>

**FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS**

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
<b>TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS</b>			<b>242.769.250,00</b>	<b>100,00%</b>
<b>FRG FA FI RENDA FIXA</b>			<b>141.370.689,05</b>	<b>58,23%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>141.379.887,42</b>	<b>58,24%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>141.379.887,42</b>	<b>58,24%</b>
Notas do Tesouro Nacional			34.407.493,69	14,17%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			34.407.493,69	14,17%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		3.738	15.422.662,38	6,35%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	18.984.831,31	7,82%
Operações Compromissadas (Adelic)		126.690	106.972.394	44,06%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>(9.198,37)</b>	<b>0,00%</b>
<b>CARTEIRA PRÓPRIA</b>			<b>101.398.560,95</b>	<b>41,77%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>82.904.781,53</b>	<b>34,15%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>82.904.781,53</b>	<b>34,15%</b>
Notas do Tesouro Nacional			82.904.781,53	34,15%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			82.904.781,53	34,15%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	38.435.891,29	15,83%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	44.468.890,24	18,32%
<b>RENDA VARIÁVEL</b>			<b>18.492.627,44</b>	<b>7,62%</b>
<b>FUNDO DE ÍNDICE - ETF</b>			18.492.627,44	7,62%
Ishares BOVA11		173.656	18.492.627,44	0,00%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>1.151,98</b>	<b>0,00%</b>