

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
4º TRIMESTRE DE 2021

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2021		2020		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	214.390.506,99	92,45%	152.954.633,07	100,00%	Até 100%
Renda Variável	17.504.524,80	7,55%	-	-	Até 10%
Estruturado	-	-	-	-	-
Exterior	-	-	-	-	-
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes (*)	-	-	-	-	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(5.991,06)	0,00%	(2.191,96)	0,00%	-
Total de Investimentos	231.889.040,73	100,00%	152.952.441,11	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	7,27%	Taxa Selic	4,35%
Renda Variável (*)	-	Ibovespa	-
Total	6,46%	Taxa Selic	4,35%

(*) 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
RENDA FIXA		132.164.312,13	56,99%
Fundos Exclusivos		132.164.312,13	56,99%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	132.164.312,13	56,99%
RENDA VARIÁVEL		17.504.524,80	7,55%
Fundo de Índice - ETF		17.504.524,80	7,55%
Ishares BOVA11	Black Rock Brasil	17.504.524,80	7,55%
Total		149.668.836,93	-

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			231.889.040,73	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			132.164.312,13	56,99%
RENDA FIXA			132.173.143,42	57,00%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			132.173.143,42	57,00%
Notas do Tesouro Nacional			34.040.288,69	14,68%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			34.040.288,69	14,68%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		3.738	15.212.873,08	6,56%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	18.827.415,61	8,12%
Operações Compromissadas (Adelic)		8.761	98.132.855	42,32%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(8.831,29)	0,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			99.724.728,60	43,01%
RENDA FIXA			82.217.363,57	35,46%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			82.217.363,57	35,46%
Notas do Tesouro Nacional			82.217.363,57	35,46%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			82.217.363,57	35,46%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	38.117.194,09	16,44%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	44.100.169,48	19,02%
RENDA VARIÁVEL			17.504.524,80	7,55%
FUNDO DE ÍNDICE - ETF			17.504.524,80	7,55%
Ishares BOVA11		173.656	17.504.524,80	0,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			2.840,23	0,00%