

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
2º TRIMESTRE DE 2022

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2022		2021		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	237.645.033,94	90,30%	214.390.506,99	92,45%	Até 100%
Renda Variável	23.115.210,00	8,78%	17.504.524,80	7,55%	Até 15%
Estruturado	-	-	-	-	-
Exterior	-	-	-	-	-
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes (*)	-	-	-	-	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	2.401.259,84	0,91%	(5.991,06)	0,00%	-
Total de Investimentos	263.161.503,78	100,00%	231.889.040,73	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	9,06%	IMA	4,49%
Renda Variável (*)	(6,26%)	Ibovespa	(5,99%)
Total	7,84%	Taxa Selic	5,41%

(*) 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		151.713.558,71	57,65%
Fundos Exclusivos		151.713.558,71	57,65%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	151.713.558,71	57,65%
RENDA VARIÁVEL		23.115.210,00	8,78%
Fundo de Índice - ETF		23.115.210,00	8,78%
Ishares BOVA11	Black Rock Brasil	23.115.210,00	8,78%
Total		174.828.768,71	-

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			263.161.503,78	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			151.713.558,71	57,65%
RENDA FIXA			147.014.791,33	55,86%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			147.014.791,33	55,86%
Notas do Tesouro Nacional			21.358.337,13	8,12%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			21.358.337,13	8,12%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		2.469	604.409,12	0,23%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	20.753.928,01	7,89%
Operações Compromissadas (Adelic)		10.630	125.656.454	47,75%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			4.698.767,38	1,79%
CARTEIRA PRÓPRIA			111.447.945,07	42,35%
RENDA FIXA			90.630.242,61	34,44%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			90.630.242,61	34,44%
Notas do Tesouro Nacional			90.630.242,61	34,44%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			90.630.242,61	34,44%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	42.017.530,09	15,97%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	48.612.712,52	18,47%
RENDA VARIÁVEL			23.115.210,00	8,78%
FUNDO DE ÍNDICE - ETF			23.115.210,00	8,78%
Ishares BOVA11		243.318	23.115.210,00	8,78%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(2.297.507,54)	-0,87%