

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
1º TRIMESTRE DE 2018

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2017		2016		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	140.553.996,56	99,73%	129.445.885,29	99,72%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	-
Investimentos Imobiliários	-	-	-	-	-
Operações com Participantes	389.629,46	0,28%	364.919,27	0,28%	Até 2%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(10.954,71)	-0,01%	(4.026,43)	0,00%	-
Total de Investimentos	140.932.671,31	100,00%	129.806.778,13	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	4,94%	Taxa Selic	1,59%
Operações com Participantes	2,97%	INPC + 5,70% ^(*)	0,69%
Total	4,92%	Taxa Selic	1,59%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 5,70% a.a. como benchmark do Segmento de Operações com Participantes foi apurada com defasagem de 2 (dois) meses para o INPC.

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
RENDA FIXA		114.987.194,64	81,59%
Fundos Exclusivos		114.987.194,64	81,59%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	114.987.194,64	81,59%
Total		114.987.194,64	81,59%

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			140.932.671,31	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			114.987.194,64	81,59%
RENDA FIXA			114.998.665,25	81,60%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			114.998.665,25	81,60%
Notas do Tesouro Nacional			63.507.536,03	45,06%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			63.507.536,03	45,06%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		6.141	21.318.300,32	15,13%
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)		6.805	42.189.235,71	29,94%
Títulos da Dívida Agrária		60	6.097,90	0,00%
Operações Compromissadas (Adelic)		15.633	51.485.031,32	36,53%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(11.470,61)	-0,01%
CARTEIRA PRÓPRIA			25.945.476,67	18,41%
RENDA FIXA			25.555.331,31	18,13%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			25.555.331,31	18,13%
Notas do Tesouro Nacional			25.555.331,31	18,13%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			25.555.331,31	18,13%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	25.555.331,31	18,13%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			389.629,46	0,28%
Saldo de Empréstimos			368.551,95	0,26%
Valores a Pagar/Receber			21.077,51	0,01%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			515,90	0,00%