

**FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS**  
**DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS**  
**2º TRIMESTRE DE 2021**

**DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO**

Segmento	2021		2020		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	226.961.535,10	91,48%	152.954.633,07	100,00%	Até 100%
Renda Variável	21.153.037,36	8,53%	-	-	Até 10%
Estruturado	-	-	-	-	-
Exterior	-	-	-	-	-
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes (*)	-	-	-	-	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(4.454,02)	0,00%	(2.191,96)	0,00%	-
<b>Total de Investimentos</b>	<b>248.110.118,44</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	8,62%	Taxa Selic	1,28%
Renda Variável (*)	-	Ibovespa	-
<b>Total</b>	<b>9,21%</b>	<b>Taxa Selic</b>	<b>1,28%</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>136.694.830,55</b>	<b>55,09%</b>
<b>Fundos Exclusivos</b>		<b>136.694.830,55</b>	<b>55,09%</b>
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	136.694.830,55	55,09%
<b>RENDA VARIÁVEL</b>		<b>21.153.037,36</b>	<b>8,53%</b>
<b>Fundo de Índice - ETF</b>		<b>21.153.037,36</b>	<b>8,53%</b>
Ishares BOVA11	Black Rock Brasil	21.153.037,36	8,53%
<b>Total</b>		<b>157.847.867,91</b>	<b>-</b>

**FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS**

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
<b>TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS</b>			<b>248.110.118,44</b>	<b>100,00%</b>
<b>FRG FA FI RENDA FIXA</b>			<b>136.694.830,55</b>	<b>55,09%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>136.703.138,14</b>	<b>55,10%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>136.703.138,14</b>	<b>55,10%</b>
Notas do Tesouro Nacional			36.728.444,95	14,80%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			36.728.444,95	14,80%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		3.738	16.059.667,96	6,47%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	20.668.776,99	8,33%
Operações Compromissadas (Adelic)		9.377	99.974.693	40,29%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>(8.307,59)</b>	<b>0,00%</b>
<b>CARTEIRA PRÓPRIA</b>			<b>111.415.287,89</b>	<b>44,91%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>90.258.396,96</b>	<b>36,38%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>90.258.396,96</b>	<b>36,38%</b>
Notas do Tesouro Nacional			90.258.396,96	36,38%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			90.258.396,96	36,38%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	41.845.136,91	16,87%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	48.413.260,05	19,51%
<b>RENDA VARIÁVEL</b>			<b>21.153.037,36</b>	<b>8,53%</b>
<b>FUNDO DE ÍNDICE - ETF</b>			21.153.037,36	8,53%
Ishares BOVA11		173.656	21.153.037,36	0,00%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>3.853,57</b>	<b>0,00%</b>