

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
2º TRIMESTRE DE 2019

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2019		2018		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	169.539.253,52	100,00%	140.553.996,56	99,73%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	-
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes *	-	-	389.629,46	0,28%	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(1.594,21)	0,00%	(10.954,71)	-0,01%	-
Total de Investimentos	169.537.659,31	100,00%	140.932.671,31	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	11,78%	Taxa Selic	3,07%
Total	11,75%	Taxa Selic	3,07%

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
RENDA FIXA		102.548.403,67	60,49%
Fundos Exclusivos		102.548.403,67	60,49%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	102.548.403,67	60,49%
Total		102.548.403,67	60,49%

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			169.537.659,31	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			102.548.403,67	60,49%
RENDA FIXA			102.550.985,56	60,49%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			102.550.985,56	60,49%
Notas do Tesouro Nacional			41.071.623,33	24,23%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			41.071.623,33	24,23%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		6.141	25.731.603,81	15,18%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	15.340.019,52	9,05%
Títulos da Dívida Agrária		30	3.115,54	0,00%
Operações Compromissadas (Adelic)		68.849	61.476.246,69	36,26%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(2.581,89)	0,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			66.989.255,64	39,51%
RENDA FIXA			66.988.267,96	39,51%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			66.988.267,96	39,51%
Notas do Tesouro Nacional			66.988.267,96	39,51%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			66.988.267,96	39,51%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	31.056.758,58	18,32%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	35.931.509,38	21,19%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			987,68	0,00%