

**FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS**  
**DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS**  
**1º TRIMESTRE DE 2020**

**DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO**

Segmento	2020		2019		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	152.954.633,07	100,00%	153.300.870,08	100,00%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	Até 20%
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes (*)	-	-	-	-	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(2.191,96)	0,00%	1.597,60	0,00%	-
<b>Total de Investimentos</b>	<b>152.952.441,11</b>	<b>100,00%</b>	<b>153.302.467,68</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	(0,62%)	Taxa Selic	1,01%
<b>Total</b>	<b>(0,62%)</b>	<b>Taxa Selic</b>	<b>1,01%</b>

**RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS**

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
<b>RENDA FIXA</b>		<b>87.474.217,69</b>	<b>57,19%</b>
<b>Fundos Exclusivos</b>		<b>87.474.217,69</b>	<b>57,19%</b>
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	87.474.217,69	57,19%
<b>Total</b>		<b>87.474.217,69</b>	<b>57,19%</b>

**FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS**

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
<b>TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS</b>			<b>152.952.441,11</b>	<b>100,00%</b>
<b>FRG FA FI RENDA FIXA</b>			<b>87.474.217,69</b>	<b>57,19%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>87.476.984,72</b>	<b>57,19%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>87.476.984,72</b>	<b>57,19%</b>
Notas do Tesouro Nacional			29.942.706,35	19,58%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			29.942.706,35	19,58%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		3.738	14.948.612,10	9,77%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	14.994.094,25	9,80%
Operações Compromissadas (Adelic)		51.672	57.534.278	37,62%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>(2.767,03)</b>	<b>0,00%</b>
<b>CARTEIRA PRÓPRIA</b>			<b>65.478.223,42</b>	<b>42,81%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>65.477.648,35</b>	<b>42,81%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>65.477.648,35</b>	<b>42,81%</b>
Notas do Tesouro Nacional			65.477.648,35	42,81%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			65.477.648,35	42,81%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	30.356.412,83	19,85%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	35.121.235,52	22,96%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>575,07</b>	<b>0,00%</b>