

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
2º TRIMESTRE DE 2020

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2020		2019		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	183.107.671,23	100,00%	153.300.870,08	100,00%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	Até 20%
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes (*)	-	-	-	-	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(1.860,13)	0,00%	1.597,60	0,00%	-
Total de Investimentos	183.105.811,10	100,00%	153.302.467,68	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	4,48%	Taxa Selic	1,75%
Total	4,48%	Taxa Selic	1,75%

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
RENDA FIXA		111.580.962,16	60,94%
Fundos Exclusivos		111.580.962,16	60,94%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	111.580.962,16	60,94%
Total		111.580.962,16	60,94%

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			183.105.811,10	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			111.580.962,16	60,94%
RENDA FIXA			111.583.394,57	60,94%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			111.583.394,57	60,94%
Notas do Tesouro Nacional			31.867.613,89	17,40%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			31.867.613,89	17,40%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		3.738	15.488.868,28	8,46%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	16.378.745,61	8,94%
Operações Compromissadas (Adelic)		19.517	79.715.781	43,54%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(2.432,41)	0,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			71.524.848,94	39,06%
RENDA FIXA			71.524.276,66	39,06%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			71.524.276,66	39,06%
Notas do Tesouro Nacional			71.524.276,66	39,06%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			71.524.276,66	39,06%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	33.159.719,76	18,11%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	38.364.556,90	20,95%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			572,28	0,00%