

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% |