

**FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS**  
**DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS**  
**3º TRIMESTRE DE 2020**

**DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO**

Segmento	2020		2019		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	205.663.309,53	100,00%	153.300.870,08	100,00%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	Até 20%
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes (*)	-	-	-	-	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(2.554,86)	0,00%	1.597,60	0,00%	-
<b>Total de Investimentos</b>	<b>205.660.754,67</b>	<b>100,00%</b>	<b>153.302.467,68</b>	<b>100,00%</b>	<b>-</b>

(\*) De acordo com a Resolução Normativa ANS N° 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	9,07%	Taxa Selic	2,28%
<b>Total</b>	<b>9,07%</b>	<b>Taxa Selic</b>	<b>2,28%</b>

**RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS**

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
<b>RENDA FIXA</b>		<b>129.847.895,15</b>	<b>63,14%</b>
<b>Fundos Exclusivos</b>		<b>129.847.895,15</b>	<b>63,14%</b>
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	129.847.895,15	63,14%
<b>Total</b>		<b>129.847.895,15</b>	<b>63,14%</b>

**FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS**

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
<b>TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS</b>			<b>205.660.754,67</b>	<b>100,00%</b>
<b>FRG FA FI RENDA FIXA</b>			<b>129.847.895,15</b>	<b>63,14%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>129.851.486,19</b>	<b>63,14%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>129.851.486,19</b>	<b>63,14%</b>
Notas do Tesouro Nacional			33.038.944,12	16,06%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			33.038.944,12	16,06%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		3.738	15.678.369,12	7,62%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	17.360.575,00	8,44%
Operações Compromissadas (Adelic)		26.348	96.812.542	47,07%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>(3.591,04)</b>	<b>0,00%</b>
<b>CARTEIRA PRÓPRIA</b>			<b>75.812.859,52</b>	<b>36,86%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>75.811.823,34</b>	<b>36,86%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>75.811.823,34</b>	<b>36,86%</b>
Notas do Tesouro Nacional			75.811.823,34	36,86%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			75.811.823,34	36,86%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	35.147.490,25	17,09%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	40.664.333,09	19,77%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>1.036,18</b>	<b>0,00%</b>