

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
3º TRIMESTRE DE 2015

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2015		2014		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	114.259.145,37	99,64%	113.512.761,53	99,63%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	-
Investimentos Imobiliários	-	-	-	-	-
Operações com Participantes	423.002,14	0,37%	427.166,05	0,37%	Até 2%
Caixa/Despesas a Pagar	(6.815,57)	-0,01%	(2.484,86)	0,00%	-
Total de Investimentos	114.675.331,94	100,00%	113.937.442,72	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	3,59%	Taxa Selic	9,58%
Operações com Participantes	6,68%	INPC + 5,50% ^(*)	13,11%
Total	3,59%	Taxa Selic	9,58%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 5,50% a.a. como benchmark do Segmento de Operações com Participantes foi apurada com defasagem de 2 (dois) meses para o INPC.

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
RENDA FIXA		94.511.441,43	82,42%
Fundos Exclusivos		94.511.441,43	82,42%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	94.511.441,43	82,42%
Total		94.511.441,43	82,42%

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			114.675.331,94	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			94.511.441,43	82,42%
RENDA FIXA			94.518.961,76	82,42%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			94.518.961,76	82,42%
Notas do Tesouro Nacional			74.792.493,40	65,22%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			74.792.493,40	65,22%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		11.905	57.012.830,15	49,72%
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)		5.584	17.779.663,25	15,50%
Títulos da Dívida Agrária		777	73.353,72	0,06%
Operações Compromissadas (Adelic)		8.007	19.653.114,64	17,14%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(7.520,33)	-0,01%
CARTEIRA PRÓPRIA			20.163.890,51	17,58%
RENDA FIXA			19.740.183,61	17,21%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			19.740.183,61	17,21%
Notas do Tesouro Nacional			19.740.183,61	17,21%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			19.740.183,61	17,21%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	19.740.183,61	17,21%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			423.002,14	0,37%
Valores a Receber			389.836,61	0,34%
Valores a Pagar			33.165,53	0,03%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			704,76	0,00%