

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
2º TRIMESTRE DE 2016

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2016		2015		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	132.360.664,98	99,75%	109.674.072,46	99,67%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	-
Investimentos Imobiliários	-	-	-	-	-
Operações com Participantes	336.988,38	0,25%	367.493,62	0,33%	Até 2%
Caixa/Despesas a Pagar	(6.270,31)	0,00%	(2.967,60)	0,00%	-
Total de Investimentos	132.691.383,05	100,00%	110.038.598,48	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	17,32%	Taxa Selic	6,73%
Operações com Participantes	9,62%	INPC + 5,70% ^(*)	8,61%
Total	17,29%	Taxa Selic	6,73%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 5,70% 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		107.471.858,23	80,99%
Fundos Exclusivos		107.471.858,23	80,99%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	107.471.858,23	80,99%
Total		107.471.858,23	80,99%

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			132.691.383,05	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA				
RENDA FIXA			107.478.628,00	81,00%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			107.478.628,00	81,00%
Notas do Tesouro Nacional			71.863.330,98	54,16%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			71.863.330,98	54,16%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)				
		11.905	71.863.330,98	54,16%
Títulos da Dívida Agrária			24.507,28	0,02%
		254	24.507,28	0,02%
Operações Compromissadas (Adelic)			35.590.789,74	26,82%
		44.257	35.590.789,74	26,82%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(6.769,77)	-0,01%
CARTEIRA PRÓPRIA				
RENDA FIXA			24.882.036,98	18,75%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			24.882.036,98	18,75%
Notas do Tesouro Nacional			24.882.036,98	18,75%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			24.882.036,98	18,75%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)				
		4.122	24.882.036,98	18,75%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			336.988,38	0,25%
Valores a Receber			305.851,97	0,23%
Valores a Pagar			31.136,41	0,02%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			499,46	0,00%