

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
3º TRIMESTRE DE 2016

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2016		2015		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	118.239.217,63	99,67%	109.674.072,46	99,67%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	-
Investimentos Imobiliários	-	-	-	-	-
Operações com Participantes	389.648,80	0,33%	367.493,62	0,33%	Até 2%
Caixa/Despesas a Pagar	(3.006,08)	0,00%	(2.967,60)	0,00%	-
Total de Investimentos	118.625.860,35	100,00%	110.038.598,48	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	20,66%	Taxa Selic	10,44%
Operações com Participantes	14,63%	INPC + 5,70% ^(*)	9,24%
Total	20,65%	Taxa Selic	10,44%

(*) 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		93.491.358,76	78,81%
Fundos Exclusivos		93.491.358,76	78,81%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	93.491.358,76	78,81%
Total		93.491.358,76	78,81%

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			118.625.860,35	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			93.491.358,76	78,81%
RENDA FIXA			93.499.550,44	78,82%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			93.499.550,44	78,82%
Notas do Tesouro Nacional			71.452.144,09	60,23%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			71.452.144,09	60,23%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		11.905	71.452.144,09	60,23%
Títulos da Dívida Agrária		164	15.494,08	0,01%
Operações Compromissadas (Adelic)		26.281	22.031.912,27	18,57%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(8.191,68)	-0,01%
CARTEIRA PRÓPRIA			25.134.501,59	21,19%
RENDA FIXA			24.739.667,19	20,86%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			24.739.667,19	20,86%
Notas do Tesouro Nacional			24.739.667,19	20,86%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			24.739.667,19	20,86%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	24.739.667,19	20,86%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			389.648,80	0,33%
Saldo de Empréstimos			359.259,86	0,30%
Valores a Pagar/Receber			30.388,94	0,03%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			5.185,60	0,00%