

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
2º TRIMESTRE DE 2021

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2021		2020		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	226.961.535,10	91,48%	152.954.633,07	100,00%	Até 100%
Renda Variável	21.153.037,36	8,53%	-	-	Até 10%
Estruturado	-	-	-	-	-
Exterior	-	-	-	-	-
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes (*)	-	-	-	-	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(4.454,02)	0,00%	(2.191,96)	0,00%	-
Total de Investimentos	248.110.118,44	100,00%	152.952.441,11	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	8,62%	Taxa Selic	1,28%
Renda Variável (*)	-	Ibovespa	-
Total	9,21%	Taxa Selic	1,28%

(*) O Fundo de Índice "ETF - BOVA11" foi adquirido em 01/03/2021, entrando na carteira em D+2 (03/03/2021).

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
RENDA FIXA		136.694.830,55	55,09%
Fundos Exclusivos		136.694.830,55	55,09%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	136.694.830,55	55,09%
RENDA VARIÁVEL		21.153.037,36	8,53%
Fundo de Índice - ETF		21.153.037,36	8,53%
Ishares BOVA11	Black Rock Brasil	21.153.037,36	8,53%
Total		157.847.867,91	-

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			248.110.118,44	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			136.694.830,55	55,09%
RENDA FIXA			136.703.138,14	55,10%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			136.703.138,14	55,10%
Notas do Tesouro Nacional			36.728.444,95	14,80%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			36.728.444,95	14,80%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		3.738	16.059.667,96	6,47%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	20.668.776,99	8,33%
Operações Compromissadas (Adelic)		9.377	99.974.693	40,29%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(8.307,59)	0,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			111.415.287,89	44,91%
RENDA FIXA			90.258.396,96	36,38%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			90.258.396,96	36,38%
Notas do Tesouro Nacional			90.258.396,96	36,38%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			90.258.396,96	36,38%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	41.845.136,91	16,87%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	48.413.260,05	19,51%
RENDA VARIÁVEL			21.153.037,36	8,53%
FUNDO DE ÍNDICE - ETF			21.153.037,36	8,53%
Ishares BOVA11		173.656	21.153.037,36	0,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			3.853,57	0,00%