

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
1º TRIMESTRE DE 2017

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2017		2016		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	108.289.974,37	99,65%	129.445.885,29	99,72%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	-
Investimentos Imobiliários	-	-	-	-	-
Operações com Participantes	383.799,21	0,35%	364.919,27	0,28%	Até 2%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(4.524,22)	0,00%	(4.026,43)	0,00%	-
Total de Investimentos	108.669.249,36	100,00%	129.806.778,13	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	6,66%	Taxa Selic	3,03%
Operações com Participantes	0,80%	INPC + 5,70% ^(*)	2,04%
Total	4,81%	Taxa Selic	3,03%

(*) 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		83.349.509,86	76,70%
Fundos Exclusivos		83.349.509,86	76,70%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	83.349.509,86	76,70%
Total		83.349.509,86	76,70%

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			108.669.249,36	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			83.349.509,86	76,70%
RENDA FIXA			83.355.119,21	76,71%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			83.355.119,21	76,71%
Notas do Tesouro Nacional			61.638.274,81	56,72%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			61.638.274,81	56,72%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		6.141	20.473.381,71	18,84%
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)		6.805	41.164.893,10	37,88%
Títulos da Dívida Agrária		92	8.784,97	0,01%
Operações Compromissadas (Adelic)		25.068	21.708.059,43	19,98%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(5.609,35)	-0,01%
CARTEIRA PRÓPRIA			25.319.739,50	23,30%
RENDA FIXA			24.934.855,16	22,95%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			24.934.855,16	22,95%
Notas do Tesouro Nacional			24.934.855,16	22,95%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			24.934.855,16	22,95%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	24.934.855,16	22,95%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			383.799,21	0,35%
Saldo de Empréstimos			363.061,06	0,33%
Valores a Pagar/Receber			20.738,15	0,02%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			1.085,13	0,00%