

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
2º TRIMESTRE DE 2017

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2017		2016		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	114.174.417,42	99,68%	129.445.885,29	99,72%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	-
Investimentos Imobiliários	-	-	-	-	-
Operações com Participantes	373.167,85	0,33%	364.919,27	0,28%	Até 2%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(5.498,10)	0,00%	(4.026,43)	0,00%	-
Total de Investimentos	114.542.087,17	100,00%	129.806.778,13	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	4,03%	Taxa Selic	5,65%
Operações com Participantes	3,15%	INPC + 5,70% ^(*)	4,12%
Total	4,81%	Taxa Selic	5,65%

(*) 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		90.296.893,52	78,83%
Fundos Exclusivos		90.296.893,52	78,83%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	90.296.893,52	78,83%
Total		90.296.893,52	78,83%

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			114.542.087,17	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			90.296.893,52	78,83%
RENDA FIXA			90.303.480,03	78,84%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			90.303.480,03	78,84%
Notas do Tesouro Nacional			58.784.969,24	51,32%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			58.784.969,24	51,32%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		6.141	19.376.495,46	16,92%
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)		6.805	39.408.473,78	34,41%
Títulos da Dívida Agrária		90	8.892,59	0,01%
Operações Compromissadas (Adelic)		36.145	31.509.618,20	27,51%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(6.586,51)	-0,01%
CARTEIRA PRÓPRIA			24.245.193,65	21,17%
RENDA FIXA			23.870.937,39	20,84%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			23.870.937,39	20,84%
Notas do Tesouro Nacional			23.870.937,39	20,84%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			23.870.937,39	20,84%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	23.870.937,39	20,84%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			373.167,85	0,33%
Saldo de Empréstimos			344.200,80	0,30%
Valores a Pagar/Receber			28.967,05	0,03%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			1.088,41	0,00%