

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
4º TRIMESTRE DE 2019

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2019		2018		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	153.300.870,08	100,00%	140.553.996,56	99,73%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	-
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes *	-	-	389.629,46	0,28%	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	1.597,60	0,00%	(10.954,71)	-0,01%	-
Total de Investimentos	153.302.467,68	100,00%	140.932.671,31	100,00%	-

* De acordo com a Resolução Normativa ANS N° 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	16,75%	Taxa Selic	5,96%
Total	16,47%	Taxa Selic	5,96%

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
RENDA FIXA		85.073.108,91	55,49%
Fundos Exclusivos		85.073.108,91	55,49%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	85.073.108,91	55,49%
Total		85.073.108,91	55,49%

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			153.302.467,68	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			85.073.108,91	55,49%
RENDA FIXA			85.075.608,20	55,50%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			85.075.608,20	55,50%
Notas do Tesouro Nacional			37.553.026,37	24,50%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			37.553.026,37	24,50%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		5.018	21.929.740,67	14,30%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	15.623.285,70	10,19%
Operações Compromissadas (Adelic)		47.729	47.522.582	31,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(2.499,29)	0,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			68.229.358,77	44,51%
RENDA FIXA			68.225.261,88	44,50%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			68.225.261,88	44,50%
Notas do Tesouro Nacional			68.225.261,88	44,50%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			68.225.261,88	44,50%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	31.630.247,38	20,63%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	36.595.014,50	23,87%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			4.096,89	0,00%