

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
4º TRIMESTRE DE 2022

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2022		2021		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	218.575.184,89	89,45%	224.284.668,95	92,39%	Até 100%
Renda Variável	25.792.252,10	10,55%	18.492.627,44	7,62%	Até 15%
Estruturado	-	-	-	-	-
Exterior	-	-	-	-	-
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes (*)	-	-	-	-	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	325,33	0,00%	(8.046,39)	0,00%	-
Total de Investimentos	244.367.762,32	100,00%	242.769.250,00	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	9,05%	IMA	9,66%
Renda Variável	4,46%	Ibovespa	4,69%
Total	8,87%	Taxa Selic	12,37%

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
RENDA FIXA		137.980.251,37	56,46%
Fundos Exclusivos		137.980.251,37	56,46%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	137.980.251,37	56,46%
RENDA VARIÁVEL		25.792.252,10	10,55%
Fundos de Índice - ETF		25.792.252,10	10,55%
Ishares BOVA11	Black Rock Brasil	19.803.962,10	8,10%
It Now BOVV11	Banco Itaú S/A	5.988.290,00	2,45%
Total		163.772.503,47	-

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			244.367.762,32	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			137.980.250,37	56,46%
RENDA FIXA			137.983.217,21	56,47%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			137.983.217,21	56,47%
Notas do Tesouro Nacional			19.050.976,55	7,80%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			19.050.976,55	7,80%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		149	595.769,47	0,24%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	18.455.207,08	7,55%
Operações Compromissadas (Adelic)		29.502	118.932.241	48,67%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(2.966,84)	0,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			106.387.511,95	43,54%
RENDA FIXA			80.591.967,68	32,98%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			80.591.967,68	32,98%
Notas do Tesouro Nacional			80.591.967,68	32,98%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			80.591.967,68	32,98%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		-	-	0,00%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		8.891	80.591.967,68	32,98%
RENDA VARIÁVEL			25.792.252,10	10,55%
FUNDO DE ÍNDICE - ETF				
Ishares BOVA11		186.918	19.803.962,10	8,10%
It Now BOVV11		53.900	5.988.290,00	10,55%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			3.292,17	0,00%