

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
3º TRIMESTRE DE 2022

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2022		2021		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	242.710.490,54	90,36%	214.390.506,99	92,45%	Até 100%
Renda Variável	25.903.634,28	9,64%	17.504.524,80	7,55%	Até 15%
Estruturado	-	-	-	-	-
Exterior	-	-	-	-	-
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes (*)	-	-	-	-	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(2.971,73)	0,00%	(5.991,06)	0,00%	-
Total de Investimentos	268.611.153,09	100,00%	231.889.040,73	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	11,14%	Taxa Selic	8,89%
Renda Variável (*)	5,07%	Ibovespa	4,97%
Total	10,79%	Taxa Selic	8,89%

(*) 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		155.399.287,14	57,85%
Fundos Exclusivos		155.399.287,14	57,85%
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	155.399.287,14	57,85%
RENDA VARIÁVEL		25.903.634,28	9,64%
Fundo de Índice - ETF		25.903.634,28	9,64%
Ishares BOVA11	Black Rock Brasil	25.903.634,28	9,64%
Total		181.302.921,42	-

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			268.611.153,09	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			155.399.282,60	57,85%
RENDA FIXA			155.403.852,28	57,85%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			155.403.852,28	57,85%
Notas do Tesouro Nacional			20.610.010,37	7,67%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			20.610.010,37	7,67%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		149	617.173,18	0,23%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	19.992.837,19	7,44%
Operações Compromissadas (Adelic)		184.951	134.793.842	50,18%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(4.569,68)	0,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			113.211.870,49	42,15%
RENDA FIXA			87.306.638,26	32,50%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			87.306.638,26	32,50%
Notas do Tesouro Nacional			87.306.638,26	32,50%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			87.306.638,26	32,50%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	40.476.657,62	15,07%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	46.829.980,64	17,43%
RENDA VARIÁVEL			25.903.634,28	9,64%
FUNDO DE ÍNDICE - ETF			25.903.634,28	9,64%
Ishares BOVA11		243.318	25.903.634,28	9,64%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			1.597,95	0,00%