

**FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS**  
**DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS**  
**4º TRIMESTRE DE 2020**

**DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO**

Segmento	2020		2019		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	212.621.100,24	100,00%	153.300.870,08	100,00%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	Até 20%
Imobiliário	-	-	-	-	-
Operações com Participantes (*)	-	-	-	-	-
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(3.974,52)	0,00%	1.597,60	0,00%	-
<b>Total de Investimentos</b>	<b>212.617.125,72</b>	<b>100,00%</b>	<b>153.302.467,68</b>	<b>100,00%</b>	<b>-</b>

(\*) 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	11,33%	Taxa Selic	2,76%
<b>Total</b>	<b>11,33%</b>	<b>Taxa Selic</b>	<b>2,76%</b>

**RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS**

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
<b>RENDA FIXA</b>		<b>134.771.352,93</b>	<b>63,39%</b>
<b>Fundos Exclusivos</b>		<b>134.771.352,93</b>	<b>63,39%</b>
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	134.771.352,93	63,39%
<b>Total</b>		<b>134.771.352,93</b>	<b>63,39%</b>

**FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS**

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
<b>TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS</b>			<b>212.617.125,72</b>	<b>100,00%</b>
<b>FRG FA FI RENDA FIXA</b>			<b>134.771.352,93</b>	<b>63,39%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>134.776.365,67</b>	<b>63,39%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>134.776.365,67</b>	<b>63,39%</b>
Notas do Tesouro Nacional			34.721.180,94	16,33%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			34.721.180,94	16,33%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		3.738	16.895.078,19	7,95%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		2.036	17.826.102,75	8,38%
Operações Compromissadas (Adelic)		10.250	100.055.185	47,06%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>(5.012,74)</b>	<b>0,00%</b>
<b>CARTEIRA PRÓPRIA</b>			<b>77.845.772,79</b>	<b>36,61%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>77.844.734,57</b>	<b>36,61%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>77.844.734,57</b>	<b>36,61%</b>
Notas do Tesouro Nacional			77.844.734,57	36,61%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			77.844.734,57	36,61%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	36.089.978,17	16,97%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.769	41.754.756,40	19,64%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>1.038,22</b>	<b>0,00%</b>