

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%	-
Total de Investimentos	212.617.125,72	100,00%	153.302.467,68	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	11,33%	Taxa Selic	2,76%
Total	11,33%	Taxa Selic	2,76%

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

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

FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			212.617.125,72	100,00%
FRG FA FI RENDA FIXA			134.771.352,93	63,39%
RENDA FIXA			134.776.365,67	63,39%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			134.776.365,67	63,39%
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%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(5.012,74)	0,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			77.845.772,79	36,61%
RENDA FIXA			77.844.734,57	36,61%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			77.844.734,57	36,61%
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%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			1.038,22	0,00%