

**FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS**  
**DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS**  
**1º TRIMESTRE DE 2016**

**DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO**

Segmento	2016		2015		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	112.481.352,68	99,73%	109.674.072,46	99,67%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	-
Investimentos Imobiliários	-	-	-	-	-
Operações com Participantes	367.493,62	0,33%	367.493,62	0,33%	Até 2%
Caixa/Despesas a Pagar	(60.765,99)	-0,05%	(2.967,60)	0,00%	-
<b>Total de Investimentos</b>	<b>112.788.080,31</b>	<b>100,00%</b>	<b>110.038.598,48</b>	<b>100,00%</b>	<b>-</b>

**RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS**

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	10,12%	Taxa Selic	3,26%
Operações com Participantes	4,84%	INPC + 5,70% <sup>(*)</sup>	4,97%
<b>Total</b>	<b>10,12%</b>	<b>Taxa Selic</b>	<b>3,26%</b>

(\*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 5,70% a.a. como benchmark do Segmento de Operações com Participantes foi apurada com defasagem de 2 (dois) meses para o INPC.

**RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS**

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total
<b>RENDA FIXA</b>		<b>89.407.932,01</b>	<b>79,27%</b>
<b>Fundos Exclusivos</b>		<b>89.407.932,01</b>	<b>79,27%</b>
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	89.407.932,01	79,27%
<b>Total</b>		<b>89.407.932,01</b>	<b>79,27%</b>

**FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS**

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
<b>TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS</b>			<b>112.788.080,31</b>	<b>100,00%</b>
<b>FRG FA FI RENDA FIXA</b>			<b>89.407.932,01</b>	<b>79,27%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>89.413.514,75</b>	<b>79,28%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>89.413.514,75</b>	<b>79,28%</b>
Notas do Tesouro Nacional			66.623.631,87	59,07%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			66.623.631,87	59,07%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		11.905	66.623.631,87	59,07%
Títulos da Dívida Agrária		256	23.715,82	0,02%
Operações Compromissadas (Adelic)		27.763	22.766.167,06	20,18%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>(5.582,74)</b>	<b>0,00%</b>
<b>CARTEIRA PRÓPRIA</b>			<b>23.380.148,30</b>	<b>20,73%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>23.067.837,93</b>	<b>20,45%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>23.067.837,93</b>	<b>20,45%</b>
Notas do Tesouro Nacional			23.067.837,93	20,45%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			23.067.837,93	20,45%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	23.067.837,93	20,45%
<b>OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES</b>			<b>367.493,62</b>	<b>0,33%</b>
Valores a Receber			330.288,17	0,29%
Valores a Pagar			37.205,45	0,03%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>(55.183,25)</b>	<b>-0,05%</b>