

**FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - FUNDOS ASSISTENCIAIS**  
**DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS**  
**4º TRIMESTRE DE 2016**

**DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO**

Segmento	2016		2015		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	129.445.885,29	99,72%	109.674.072,46	99,67%	Até 100%
Renda Variável	-	-	-	-	-
Investimentos Imobiliários	-	-	-	-	-
Operações com Participantes	364.919,27	0,28%	367.493,62	0,33%	Até 2%
Caixa/Despesas a Pagar	(4.026,43)	0,00%	(2.967,60)	0,00%	-
<b>Total de Investimentos</b>	<b>129.806.778,13</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	18,59%	Taxa Selic	14,02%
Operações com Participantes	17,97%	INPC + 5,70% <sup>(*)</sup>	14,65%
<b>Total</b>	<b>20,65%</b>	<b>Taxa Selic</b>	<b>14,02%</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>105.587.650,35</b>	<b>81,34%</b>
<b>Fundos Exclusivos</b>		<b>105.587.650,35</b>	<b>81,34%</b>
FRG FA FI Renda Fixa	Real Grandeza	105.587.650,35	81,34%
<b>Total</b>		<b>105.587.650,35</b>	<b>81,34%</b>

**FUNDOS ASSISTENCIAIS - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS**

Discriminação	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
<b>TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS</b>			<b>129.806.778,13</b>	<b>100,00%</b>
<b>FRG FA FI RENDA FIXA</b>			<b>105.587.650,35</b>	<b>81,34%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>105.596.860,04</b>	<b>81,35%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>105.596.860,04</b>	<b>81,35%</b>
Notas do Tesouro Nacional			68.879.826,69	53,06%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			68.879.826,69	53,06%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		11.905	68.879.826,69	53,06%
Títulos da Dívida Agrária		92	8.328,81	0,01%
Operações Compromissadas (Adelic)		42.190	36.708.704,54	28,28%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>(9.209,69)</b>	<b>-0,01%</b>
<b>CARTEIRA PRÓPRIA</b>			<b>24.219.127,78</b>	<b>18,66%</b>
<b>RENDA FIXA</b>			<b>23.849.025,25</b>	<b>18,37%</b>
<b>Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)</b>			<b>23.849.025,25</b>	<b>18,37%</b>
Notas do Tesouro Nacional			23.849.025,25	18,37%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			23.849.025,25	18,37%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		4.122	23.849.025,25	18,37%
<b>OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES</b>			<b>364.919,27</b>	<b>0,28%</b>
Saldo de Empréstimos			342.441,24	0,26%
Valores a Pagar/Receber			22.478,03	0,02%
<b>CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER</b>			<b>5.183,26</b>	<b>0,00%</b>