

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
3º TRIMESTRE DE 2024

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2024		2023		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	14.273.646.183,86	90,18%	12.288.027.108,86	78,00%	Até 100%
Renda Variável	368.510.979,33	2,33%	2.598.494.405,62	16,49%	Até 10%
Estruturado	387.033.693,37	2,45%	95.744.827,41	0,61%	Até 10%
Exterior	331.519.117,57	2,09%	-	0,00%	Até 10%
Imobiliário	395.591.488,29	2,50%	515.944.480,68	3,28%	Até 10%
Operações com Participantes	72.003.390,08	0,45%	151.554.995,97	0,96%	Até 2%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(161.447,84)	0,00%	103.900.988,59	0,66%	-
Total de Investimentos	15.828.143.404,68	100,00%	15.753.666.807,13	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	7,72%	IMA	4,99%
Títulos a Mercado	7,22%	IMA	4,99%
Títulos na Curva	8,44%	INPC + 4,98%	7,13%
Renda Variável	(3,19%)	IBOVESPA	(1,77%)
Exterior	13,07%	USD	12,53%
Estruturado	(2,14%)	IHFA	3,62%
Imobiliário	(3,25%)	IFIX	(0,16%)
Operações com Participantes	8,07%	INPC + 4,98% ^(*)	7,44%
Total	5,66%	INPC + 4,98%	7,13%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 4,98% a.a. como benchmark do Segmento de Operações com Participantes foi apurada com defasagem de 2 (dois) meses.

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no Total	Partic. Total Terceirizado ^(**)
MULTIMERCADO/RENDA FIXA		15.280.650.965,80	96,54%	-
Fundos Exclusivos		15.280.650.965,80	96,54%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	15.280.650.965,80	96,54%	-
ESTRUTURADO		79.946.157,03	0,51%	100,00%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia	BRZ Investimentos	36.305.249,57	0,23%	45,41%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia	DGF Investimentos	8.983.437,26	0,06%	11,24%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia	Ória Gestão de Recursos	25.550.479,11	0,16%	31,96%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	771.607,03	0,00%	0,97%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP	Pátria Investimentos	8.335.384,06	0,05%	10,43%
Total		15.360.597.122,83	97,05%	-

(**) Esta coluna apresenta a distribuição de recursos entre os gestores terceirizados.

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.	
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			15.828.143.404,68	100,00%	
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADO			15.280.650.965,80	96,54%	
RENDA FIXA			14.273.646.183,86	90,18%	
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			12.202.604.772,03	77,09%	
Notas do Tesouro Nacional			2.416.579	10.948.576.849,87	69,17%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			196.140	1.265.213.252,11	7,99%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2026)			90.000	386.676.284	2,44%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			106.140	878.536.968	5,55%
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			2.220.439	9.683.363.597,76	61,18%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2028)			103.751	458.138.805	2,89%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2030)			63.932	285.790.406	1,81%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2032)			65.650	283.239.612	1,79%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2033)			139.236	616.103.511	3,89%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			524.146	2.158.597.983	13,64%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2040)			318.991	1.425.305.569	9,00%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			330.497	1.355.842.152	8,57%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			139.999	609.246.892	3,85%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			150.593	602.004.103	3,80%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2060)			134.320	565.891.122	3,58%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			150.159	1.222.519.440	7,72%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			99.165	100.684.002	0,64%
BEM FI RF SIMPL TPF			281.815.674	1.254.027.922,16	7,92%
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			6.206.537,83	0,04%	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			6.620	6.206.537,83	0,04%
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis			4.620	2.606.458	0,02%
Proman - Produtores Energéticos de Manso			2.000	3.600.079	0,02%
FRG Consolidador Refix FIM			1.951.430.610	2.013.127.820,35	12,72%
FRG FIF MULT CP			500.000	51.707.053,65	0,33%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(112.651,32)	0,00%	
RENDA VARIÁVEL			3.298.739	368.510.779,33	2,33%
FRG Consolidador RV FIM			3.298.739	368.510.779,33	2,33%
ESTRUTURADO					
FOF FRG FIC FIM			2.833.427	307.087.536	1,94%
EXTERIOR					
BSHY39			5.845.867	331.519.118	2,09%
CARTEIRA PRÓPRIA				547.492.438,88	3,46%
RENDA VARIÁVEL				200,00	0,00%
Mercado à Vista			20.000	200,00	0,00%
Proman - Produtores Energéticos de Manso			ON 20.000	200,00	0,00%
ESTRUTURADO				79.946.157,03	0,51%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia			41.163	36.305.250	0,23%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia			14.818	8.983.437	0,06%
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia			25.550.479	25.550.479	0,16%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1			771.607	771.607	0,00%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP			43.534	8.335.384	0,05%
IMOBILIÁRIO			1	395.591.488,29	2,50%
Certificados de Recebíveis Imobiliários			1	80.583.229,84	0,51%
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital			1	80.583.229,84	0,51%
Edificações de Uso Próprio				23.400.000,00	0,15%
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ				23.400.000,00	0,15%
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)				293.200.000,00	1,85%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ				92.529.317,00	0,58%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ				68.970.683,00	0,44%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ				131.700.000,00	0,83%
Valores a Receber				(0,00)	0,00%
Valores a Pagar				(1.591.741,55)	-0,01%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES				72.003.390,08	0,45%
Saldo de Empréstimos				71.666.081,83	0,45%
Valores a Receber				341.687,38	0,00%
Valores a Pagar				4.379,13	0,00%

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(48.796,52)	0,00%