

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE CONTRIBUIÇÃO DEFINIDA
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
3º TRIMESTRE DE 2021

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2021		2020		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	1.277.032.012,88	67,78%	1.217.779.784,29	77,63%	Até 100%
Renda Variável	530.859.287,97	28,18%	269.595.749,25	17,19%	Até 45%
Estruturado	5.976.333,32	0,32%	6.791.439,14	0,43%	Até 19%
Exterior	-	-	-	-	Até 10%
Imobiliário	7.545.300,00	0,40%	8.818.600,00	0,56%	Até 10%
Operações com Participantes	61.507.562,86	3,26%	64.272.521,96	4,10%	Até 7%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	1.177.743,59	0,06%	1.371.396,20	0,09%	-
Total de Investimentos	1.884.098.240,62	100,00%	1.568.629.490,84	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	(1,73%)	IMA	(0,38%)
Renda Variável	(8,97%)	-	-
Carteira de Ações em Mercado (Própria)	(10,63%)	IBrX	(5,99%)
FRG FIA Western Asset	(15,29%)	IBrX	(5,99%)
FRG FIA Sharp	(5,01%)	IBrX	(5,99%)
FRG FIA FT	(4,09%)	IBrX	(5,99%)
FRG FIA Claritas	(0,02%)	IBrX	(5,99%)
Estruturado	5,29%	IMA-B +2%	(0,84%)
Imobiliário	(2,40%)	IFIX	(5,38%)
Operações com Participantes	20,71%	IGP-DI + 3,94% (*)	23,54%
Total	(2,95%)	IGP-DI + 3,94%	18,59%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do IGP-DI + 3,94% a.a. como benchmark do Segmento de Operações com Participantes foi apurada com defasagem de 2 (dois) meses para o IGP-DI.

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total	Partic. Total Terceirizado (**)
MULTIMERCADO/RENDA FIXA		1.491.685.792,44	79,17%	-
Fundos Exclusivos		1.491.685.792,44	79,17%	-
FRG Plano CD FI Multimercado	Real Grandeza	1.491.685.792,44	79,17%	-
ESTRUTURADO		5.976.333,32	0,32%	1,81%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia	BRZ Investimentos	961.499,79	0,05%	0,29%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia	DGF Investimentos	1.036.624,55	0,06%	0,31%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia	Ória Gestão de Recursos	2.390.835,91	0,13%	0,72%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	169.441,59	0,01%	0,05%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP	Pátria Investimentos	1.417.931,48	0,08%	0,43%
IMOBILIÁRIO		7.545.300,00	0,40%	2,28%
FII Rio Bravo Renda Varejo	Rio Bravo Investimentos	7.545.300,00	0,40%	2,28%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA		168.802.830,28	8,96%	51,01%
FRG FIA Western Asset	Western Asset Management	5.208.480,10	0,28%	1,57%
FRG FIA Sharp	Sharp Capital	46.326.772,84	2,46%	25,41%
FRG FIA FT	Franklin Templeton	60.448.008,27	3,21%	33,15%
FRG FIA Claritas	Claritas Adm. de Recursos	56.819.569,07	3,02%	31,16%
FUNDO DE ÍNDICE - ETF		148.577.190,78	7,89%	44,90%
Ishares BOVA11	Black Rock Brasil	148.577.190,78	7,89%	44,90%
Total		1.822.587.446,82	96,74%	-

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

PLANO CD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			1.884.098.240,62	100,00%
FRG PLANO CD FI MULTIMERCADO			1.491.685.792,44	79,17%
RENDA FIXA			1.277.032.012,88	67,78%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			1.228.690.535,36	65,21%
Notas do Tesouro Nacional			520.191.878,56	27,61%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			520.191.878,56	27,61%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)		10.212	43.777.723,78	2,32%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)		60.063	253.344.157,99	13,45%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)		25.602	108.374.526,99	5,75%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		3.586	33.437.919,98	1,77%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2023)		40.861	42.185.072,45	2,24%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)		36.250	36.882.880,61	1,96%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2027)		2.192	2.189.596,76	0,12%
Operações Compromissadas (Adelic)		738.527	708.498.656,80	37,60%
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			48.341.477,52	2,57%
Letras Financeiras			48.341.477,52	2,57%
Bradesco (Vencimento: 08/09/2023)		3	8.299.520,20	0,44%
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)		7	16.188.787,23	0,86%
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)		5	9.468.629,93	0,50%
Bradesco (Vencimento: 04/09/2028)		9	14.384.540,16	0,76%
RENDA VARIÁVEL			213.479.266,91	11,33%
Mercado à Vista			213.479.266,91	11,33%
Alpargatas	PN	39.154	2.067.331	0,11%
Assai	ON	421.563	8.026.560	0,43%
B3	ON	498.451	6.350.266	0,34%
Brasil	ON	113.929	3.292.548	0,17%
Bradesco	PN	158.493	3.301.409	0,18%
Banco Inter	UNT	58.200	2.715.030	0,14%
Bradespar	PN	71.258	3.724.656	0,20%
Petrobras BR	ON	170.202	3.998.045	0,21%
CCR S.A.	ON	152.598	1.785.397	0,09%
Cesp	PNB	35.636	841.366	0,04%
Cielo	ON	190.056	435.228	0,02%
CPFL Energia	ON	148.606	4.001.960	0,21%
Cyrela Realt	ON	69.853	1.257.354	0,07%
Ecorodovias	ON	53.453	480.008	0,03%
Equatorial	ON	273.873	6.942.681	0,37%
Eztec	ON	99.810	2.279.660	0,12%
Gerdau	PN	82.616	2.238.894	0,12%
Notre Dame Intermédica	ON	105.118	7.842.854	0,42%
Gerdau Met.	PN	178.178	2.212.971	0,12%
Hapvida	ON	521.914	7.092.811	0,38%
Hypera	ON	125.521	4.034.245	0,21%
Itausa	PN	1.345.819	14.992.424	0,80%
ItauUnibanco	PN	397.848	11.509.743	0,61%
Jhsf Part.	ON	326.561	1.933.241	0,10%
Klabin	UNT	92.776	2.246.107	0,12%
Locamerica	ON	82.578	2.005.820	0,11%
Lojas Renner	ON	228.062	7.849.894	0,42%
Locaweb	ON	39.193	896.736	0,05%
Magaz Luiza	ON	122.587	1.757.898	0,09%
Movida	ON	168.863	2.892.623	0,15%
Marrfrig	ON	124.704	3.199.905	0,17%
Multiplan	ON	43.662	830.888	0,04%
Natura	ON	220.513	10.048.777	0,53%
Petrobras	PN	720.214	19.611.427	1,04%
Pet Center	ON	28.508	668.798	0,04%
Petrorio	ON	295.695	7.398.289	0,39%
RaiaDrogasil	ON	17.818	416.407	0,02%
Randon Part	PN	109.632	1.291.465	0,07%
Rede D'or	ON	39.196	2.661.800	0,14%
Localiza	ON	82.331	4.484.570	0,24%
Santander	UNT	26.133	924.324	0,05%
Sul America	UNT	103.092	2.626.784	0,14%
Suzano S.A.	ON	98.564	5.373.709	0,29%
Totvs	ON	50.355	1.817.816	0,10%
Vale	ON	392.550	29.928.012	1,59%
Viavarejo	ON	154.415	1.190.540	0,06%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			1.174.512,65	0,06%
CARTEIRA PRÓPRIA			392.412.448,18	20,83%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA			168.802.830,28	8,96%
FRG FIA Western Asset		2.432.390	5.208.480,10	0,28%
FRG FIA Sharp		14.892.981	46.326.772,84	2,46%
FRG FIA FT		277.900	60.448.008,27	3,21%
FRG FIA Claritas		39.351.204	56.819.569,07	3,02%
FUNDO DE ÍNDICE - ETF			148.577.190,78	7,89%
Ishares BOVA11		1.395.222	148.577.190,78	7,89%
ESTRUTURADO			5.976.333,32	0,32%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia		1.257	961.499,79	0,05%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia		1.267	1.036.624,55	0,06%
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia		1.237.291	2.390.835,91	0,13%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1		1.823	169.441,59	0,01%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP		2.177	1.417.931,48	0,08%
IMOBILIÁRIO			7.545.300,00	0,40%
FII Rio Bravo Renda Varejo (ex-Agências Caixa)		70.000	7.545.300	0,40%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			61.507.562,86	3,26%
Saldo de Empréstimos			60.585.188,58	3,22%
Valores a Pagar/Receber			922.374,28	0,05%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			3.230,94	0,00%