

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
1º TRIMESTRE DE 2023

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2023		2022		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	12.582.782.765,00	80,49%	12.288.027.108,86	78,00%	Até 100%
Renda Variável	1.998.924.283,14	12,79%	2.598.494.405,62	16,49%	Até 25%
Estruturado	250.832.020,10	1,60%	95.744.827,41	0,61%	Até 10%
Exterior	-	0,00%	-	0,00%	Até 10%
Imobiliário	517.450.311,32	3,31%	515.944.480,68	3,28%	Até 10%
Operações com Participantes	140.748.163,60	0,90%	151.554.995,97	0,96%	Até 5%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	141.964.556,46	0,91%	103.900.988,59	0,66%	-
Total de Investimentos	15.632.702.099,62	100,00%	15.753.666.807,13	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	3,24%	IMA	3,63%
Títulos a Mercado	3,05%	IMA	3,63%
Títulos na Curva	3,45%	INPC + 4,86%	3,10%
Renda Variável	(7,45%)	IBOVESPA	(7,16%)
Carteira de Ações em Mercado (Própria)	0,00%	IBOVESPA	(7,16%)
FRG FIA Sharp	(8,05%)	IBOVESPA	(7,16%)
FRG FIA Claritas	(7,69%)	IBOVESPA	(7,16%)
Estruturado	(9,72%)	IHFA	0,81%
Imobiliário	0,01%	IFIX	(3,70%)
Operações com Participantes	3,22%	INPC + 4,86% (*)	2,73%
Total	1,38%	INPC + 4,86%	3,10%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 4,86% 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		12.583.239.818,43	80,49%	-
Fundos Exclusivos		12.583.239.818,43	80,49%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	12.583.239.818,43	80,49%	-
ESTRUTURADO		250.832.020,10	1,60%	11,00%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia	BRZ Investimentos	37.490.629,46	0,24%	1,64%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia	DGF Investimentos	7.711.196,77	0,05%	0,34%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia	Ória Gestão de Recursos	24.863.474,28	0,16%	1,09%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	2.697.921,58	0,02%	0,12%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP	Pátria Investimentos	13.729.902,53	0,09%	0,60%
FOF FRG FIC FIM	Real Grandeza	164.338.895,48	1,05%	7,21%
IMOBILIÁRIO		30.119.100,00	0,19%	1,32%
FII Rio Bravo Renda Varejo	Rio Bravo Investimentos	30.119.100,00	0,19%	1,32%
FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA		587.919.518,49	3,76%	25,79%
FRG FIA Sharp	Sharp Capital	422.970.988,78	2,71%	18,55%
FRG FIA Claritas	Claritas Adm. de Recursos	164.948.529,71	1,06%	7,23%
FUNDOS DE ÍNDICE - ETF		1.411.004.564,65	9,03%	61,89%
Ishares BOVA11	Black Rock Brasil	1.387.663.528,65	8,88%	60,87%
It Now BOVV11	Banco Itaú S/A	23.341.036,00	0,15%	1,02%
Total		14.863.115.021,67	95,08%	-

(**) 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			15.632.702.099,62	100,00%		
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADO			12.583.239.818,43	80,49%		
RENDA FIXA			12.582.782.765,00	80,49%		
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			12.115.634.710,01	77,50%		
Notas do Tesouro Nacional			11.746.192.164,09	75,14%		
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			4.590.984.177,44	29,37%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			310.730	1.273.343.035	8,15%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2028)			15.523	64.086.830	0,41%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2030)			15.465	63.919.777	0,41%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2035)			158.370	655.033.476	4,19%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			191.258	776.680.472	4,97%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			199.718	1.757.920.587	11,25%	
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			7.155.207.986,65	45,77%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			9.223	37.494.339	0,24%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2028)			48.000	201.351.245	1,29%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2030)			38.000	163.602.498	1,05%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2032)			10.650	42.705.430	0,27%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			480.578	1.839.904.297	11,77%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2040)			232.991	983.189.895	6,29%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			290.497	1.103.388.329	7,06%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			99.999	407.757.167	2,61%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			242.593	920.432.432	5,89%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2060)			20.600	79.385.693	0,51%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			150.159	1.279.600.825	8,19%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			99.165	96.395.837	0,62%	
Operações Compromissadas (Adelic)			374.976	369.442.546	2,36%	
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			467.148.054,99	2,99%		
Letras Financeiras			437.651.348,69	2,80%		
Bradesco (Vencimento: 08/09/2023)			13	41.189.990	0,26%	
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)			30	79.049.351	0,51%	
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)			25	53.390.545	0,34%	
Bradesco (Vencimento: 04/09/2028)			100	175.532.150	1,12%	
Bradesco (Vencimento: 09/10/2028)			60	88.489.313	0,57%	
Debêntures Não Conversíveis			23.257.356,97	0,15%		
Vale (Vencimento: 08/07/2050)			655.840	23.257.357	0,15%	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			6.239.349,33	0,04%		
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis			4.620	2.589.741	0,02%	
Proman - Produtores Energéticos de Manso			2.000	3.649.608	0,02%	
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			457.053,43	0,00%		
CARTEIRA PRÓPRIA			3.049.462.281,19	19,51%		
RENDA VARIÁVEL			1.998.924.283,14	12,79%		
FUNDO DE ÍNDICE - ETF			1.411.004.564,65	9,03%		
Ishares BOVA11			14.089.385	1.387.663.529	8,88%	
It Now BOVV11			226.612	23.341.036	0,15%	
Mercado à Vista			200,00	200,00	0,00%	
Proman - Produtores Energéticos de Manso			ON	20.000	200,00	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA			587.919.518,49	3,76%		
FRG FIA Sharp			140.088.361	422.970.988,78	2,71%	
FRG FIA Claritas			117.852.476	164.948.529,71	1,06%	
ESTRUTURADO			250.832.020,10	1,60%		
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia			41.163	37.490.629	0,24%	
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia			14.713	7.711.197	0,05%	
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia			23.508.539	24.863.474	0,16%	
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1			45.253	2.697.922	0,02%	
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP			43.534	13.729.903	0,09%	
FOF FRG FIC FIM			1.660.035	164.338.895	1,05%	
IMOBILIÁRIO			517.450.311,32	3,31%		
Certificados de Recebíveis Imobiliários			70.673.197,42	70.673.197,42	0,45%	

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital		1	70.673.197,42	0,45%
FII Rio Bravo Renda Varejo (ex-Agências Caixa)		330.000	30.119.100	0,19%
Edificações de Uso Próprio			35.000.000,00	0,22%
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ			35.000.000,00	0,22%
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			380.090.000,01	2,43%
Rodovia Presidente Dutra, 238 - Rio de Janeiro - RJ			10.990.000,01	0,07%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ			116.879.136,00	0,75%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ			87.120.864,00	0,56%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ			165.100.000,00	1,06%
Valores a Receber			1.914.703,44	0,01%
Valores a Pagar			(346.689,55)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			140.748.163,60	0,90%
Saldo de Empréstimos			140.401.007,84	0,90%
Valores a Receber			352.051,35	0,00%
Valores a Pagar			(4.895,59)	0,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			141.507.503,03	0,91%