

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
4º TRIMESTRE DE 2024

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2024		2023		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	14.276.280.116,21	91,03%	12.288.027.108,86	78,00%	Até 100%
Renda Variável	288.945.955,77	1,84%	2.598.494.405,62	16,49%	Até 10%
Estruturado	317.833.073,05	2,03%	95.744.827,41	0,61%	Até 10%
Exterior	339.930.018,62	2,17%	-	0,00%	Até 10%
Imobiliário	398.743.811,21	2,54%	515.944.480,68	3,28%	Até 10%
Operações com Participantes	61.972.636,88	0,40%	151.554.995,97	0,96%	Até 2%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(159.223,04)	0,00%	103.900.988,59	0,66%	-
Total de Investimentos	15.683.546.388,72	100,00%	15.753.666.807,13	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	10,82%	IMA	5,10%
Títulos a Mercado	6,00%	IMA	5,10%
Títulos na Curva	12,06%	INPC + 4,98%	9,99%
Renda Variável	(15,89%)	IBOVESPA	(10,36%)
Exterior	11,95%	USD	27,91%
Estruturado	6,23%	IHFA	5,76%
Imobiliário	(2,68%)	IFIX	11,80%
Operações com Participantes	11,80%	INPC + 4,98% ^(*)	11,80%
Total	7,28%	INPC + 4,98%	9,99%

(*) 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		15.222.858.257,60	97,06%	-
Fundos Exclusivos		15.222.858.257,60	97,06%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	15.222.858.257,60	97,06%	-
Total		15.222.858.257,60	97,06%	-

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.	
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			15.683.546.388,72	100,00%	
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADO			15.222.858.257,60	97,06%	
RENDA FIXA			14.276.280.116,21	91,03%	
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			12.253.043.207,54	78,13%	
Notas do Tesouro Nacional			2.416.579	11.148.085.728,56	71,08%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			196.140	1.291.274.343,11	8,23%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2026)			90.000	392.182.220	2,50%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			106.140	899.092.123	5,73%
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			2.220.439	9.856.811.385,45	62,85%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2028)			103.751	471.163.827	3,00%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2030)			63.932,00	293.829.127	1,87%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2032)			65.650,00	291.691.309	1,86%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2033)			139.236	616.044.553	3,93%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			524.146	2.158.642.625	13,76%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2040)			318.991	1.466.366.119	9,35%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			330.497	1.354.810.012	8,64%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			139.999	627.195.652	4,00%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			150.593	601.196.307	3,83%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2060)			134.320	582.891.133	3,72%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			150.159	1.289.028.304	8,22%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			99.165	103.952.418	0,66%
BEM FI RF SIMPL TPF			241.935.017	1.104.957.478,98	7,05%
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			5.966.022,51	0,04%	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			6.620	5.966.022,51	0,04%
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis			4.620	2.590.001	0,02%
Proman - Produtores Energéticos de Manso			2.000	3.376.021	0,02%
FRG Consolidador Refix FIM			2.019.300.949	1.964.318.615,01	12,52%
FRG FIF MULT CP			500.000	52.952.271,15	0,34%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(130.706,07)	0,00%	
RENDA VARIÁVEL			2.938.432	288.945.755,77	1,84%
FRG Consolidador RV FIM			2.938.432	288.945.755,77	1,84%
ESTRUTURADO			2.833.427	317.833.073,05	2,03%
FOF FRG FIC FIM			2.833.427	317.833.073	2,03%
EXTERIOR			303.650.468	339.930.018,62	2,17%
FRG HEDGE			303.650.468	339.930.019	2,17%
CARTEIRA PRÓPRIA			460.688.131,12	2,94%	
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%
IMOBILIÁRIO			-	398.743.811,21	2,54%
Certificados de Recebíveis Imobiliários			-	82.316.924,09	0,52%
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital			-	82.316.924,09	0,52%
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	1,87%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ				92.529.317,00	0,59%
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	0,84%
Valores a Receber				(0,00)	0,00%
Valores a Pagar				(173.112,88)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			61.972.636,88	0,40%	
Saldo de Empréstimos				61.972.636,88	0,40%
Valores a Receber				0,00%	0,00%
Valores a Pagar				0,00%	0,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(28.516,97)	0,00%	