

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE CONTRIBUIÇÃO DEFINIDA
RESUMO DO DEMONSTRATIVO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS E DE ENQUADRAMENTO DAS APLICAÇÕES
Ano de 2011

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	Dezembro/2011		Dezembro/2010		Limites da Política de Investimentos
	R\$	%	R\$	%	
Renda Fixa	200.710.137,07	67,90%	163.407.359,32	71,82%	Até 100%
Renda Variável	62.186.632,87	21,04%	39.060.052,44	17,17%	Até 35%
Investimentos Imobiliários	-	0,00%	-	0,00%	-
Empréstimos e Financiamentos	31.188.380,41	10,55%	23.255.034,03	10,22%	Até 15%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	1.502.014,61	0,51%	1.788.036,43	0,79%	-
Depósitos	-	0,00%	-	0,00%	-
Total de Investimentos	295.587.164,96	100,00%	227.510.482,22	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Valor da Cota	Rentabilidade no Trimestre	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	1,70399	3,82%	12,12%	IMA	13,61%
Renda Variável	1,27768	8,67%	-6,27%	-	-
Carteira de Mercado	1,27253	8,79%	-7,26%	IBrX	-11,39%
Carteira de Ativos Diversos	1,86446	3,94%	16,71%	IBrX	-11,39%
Empréstimos e Financiamentos	1,65596	3,45%	13,05%	IGP-DI + 6%*	13,20%
Total	1,57080	4,82%	9,01%	IGP-DI + 6%	11,31%

* De acordo com a Política de Investimentos, a variação do IGP-DI + 6% a.a. como benchmark do Segmento de Empréstimos e Financiamentos foi apurada com defasagem de 2 (dois) meses para o IGP-DI.

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Saldo (R\$)	Participação no total
RENDA FIXA	262.896.769,94	88,94%
Fundos Exclusivos	262.896.769,94	88,94%
FRG Plano CD FI Multimercado	262.896.769,94	88,94%
TOTAL	262.896.769,94	88,94%

TOTAL DE RECURSOS ADMINISTRADOS PELA REAL GRANDEZA

Segmento	Plano BD	Plano CD	Fundos Assistenciais	Programa Administrativo	Total
Renda Fixa	6.890.461.845,42	200.710.137,07	118.343.770,56	52.309.390,30	7.261.825.143,35
Renda Variável	1.559.859.901,77	62.186.632,87	-	-	1.622.046.534,64
Investimentos Estruturados	108.105.181,77	-	-	-	108.105.181,77
Investimentos Imobiliários	375.106.939,77	-	-	-	375.106.939,77
Empréstimos e Financiamentos	265.882.554,40	31.188.380,41	292.498,15	-	297.363.432,96
Caixa/Despesas a Pagar	18.377.554,64	1.502.014,61	991,80	-1.947,15	19.878.613,90
Depósitos	-	-	-	-	-
Total	9.217.793.977,77	295.587.164,96	118.637.260,51	52.307.443,15	9.684.325.846,39

RENTABILIDADES DOS PLANOS ADMINISTRADOS PELA REAL GRANDEZA

Período	Plano BD	Plano CD	Fundos Assistenciais	Programa Administrativo	Total
Ano de 2011	11,88%	9,01%	12,18%	11,52%	11,81%

Responsáveis

KPMG Auditores Independentes
Auditor de Gestão

Eduardo Henrique Garcia
Administrador Responsável

PLANO CD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	Valor de Mercado (R\$)	% Aplic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			295.587.164,96	100,00
BRADESCO FI MULTIMERCADO			262.896.769,94	88,94
RENDA FIXA			200.710.137,07	67,90
Notas do Tesouro Nacional		39.465	102.044.175,66	34,52
ADELIC		36.552	79.667.374,56	26,95
TDA		668	60.266,62	0,02
CDB			2.646.221,30	
BNP S.A.		2.500	2.646.221,30	0,90
LF			6.372.112	2,16
ITAU		2	2.210.589	0,75
BRADESCO		2	2.215.626	0,75
SAFRA		2	881.678	0,30
ITAU		1	1.064.218	0,36
Quotas de FIDC		2.583	2.590.086,61	0,88
CHEMICALVI FIDC		2.583	2.590.086,61	0,88
Debêntures não Conversíveis		5.012	7.329.900,81	2,48
TELEMAR PARTICIPAÇÕES S.A.		90	370.021,95	0,13
DUKE ENERGY INTERNACIONAL – Geração Paranapanema S.A.		50	262.696,40	0,09
Natura Cosméticos S.A.		1	1.012.675,76	0,34
BNDES PARTICIPAÇÕES S.A.		3.744	4.378.863,00	1,48
BNDES PARTICIPAÇÕES S.A.		1.127	1.305.643,70	0,44
RENDA VARIÁVEL			62.186.632,87	21,04
Mercado à Vista			61.936.916,49	20,95
AMBEV PN *EDJ	PN	60.000	4.038.000,00	1,37
BANCO DO BRASIL	ON	99.900	2.367.630,00	0,80
BANCO BRADESCO S.A.	PN	142.394	4.378.615,50	1,48
BFR - BRASIL FOODS S.A.	ON	80.500	2.931.810,00	0,99
BR MALLS PARON	ON	43.000	779.160,00	0,26
CCR - COMPANHIA DE CONCESSÕES RODOVIÁRIAS	ON	134.000	1.637.480,00	0,55
CIELO ON NM	ON	34.000	1.638.800,00	0,55
CIA. ENERGÉTICA DE MINAS GERAIS - CEMIG	PN	63.398	2.109.251,46	0,71
CIA. SIDERÚRGICA NACIONAL - CSN	ON	126.900	1.900.962,00	0,64
DIAGNÓSTICOS DA AMÉRICA S.A. - DASA	ON	72.300	1.120.650,00	0,38
GERDAU S.A.	PN	153.000	2.218.500,00	0,75
ITAUSAPN N1	PN	279.129	3.148.575,12	1,07
ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A.	PN	154.800	5.261.652,00	1,78
LOJAS RENNERTON NM	ON	22.500	1.089.225,00	0,37
PDG REALTON NM	ON	99.000	584.100,00	0,20
PETRÓLEO BRASILEIRO S.A. - PETROBRÁS	ON	240.164	5.523.772,00	1,87
PETRÓLEO BRASILEIRO S.A. - PETROBRÁS	PN	334.109	7.180.002,41	2,43
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	ON	49.500	1.267.200,00	0,43
ULTRAPAR PARTICIPAÇÕES S.A.	ON	49.600	1.587.696,00	0,54
CIA VALE DO RIO DOCE	ON	77.200	3.045.540,00	1,03
CIA VALE DO RIO DOCE	PNA	157.600	5.960.432,00	2,02
VIVT - TELEF BRASIL PN	PN	41.770	2.167.863,00	0,73
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			249.716,38	0,08
CARTEIRA PRÓPRIA			1.502.014,61	0,51
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			1.502.014,61	0,51
EMPRÉSTIMOS A PARTICIPANTES			31.188.380,41	10,55
Valores a Receber			30.592.803,02	10,35
Valores a Pagar			595.577,39	0,20