

**FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE CONTRIBUIÇÃO DEFINIDA
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
4º TRIMESTRE DE 2023**

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2023		2022		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	1.599.223.542,54	67,39%	1.527.982.728,29	73,82%	Até 100%
Renda Variável	457.459.483,74	19,28%	495.051.376,87	23,92%	Até 30%
Estruturado	235.928.042,03	9,94%	4.641.259,91	0,22%	Até 15%
Exterior	51.573.522,00	2,17%	-	-	Até 10%
Imobiliário	7.949.200,00	0,33%	6.455.400,00	0,31%	Até 12%
Operações com Participantes	20.830.941,80	0,88%	35.292.413,50	1,70%	Até 5%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(24.360,33)	0,00%	583.390,06	0,03%	-
Total de Investimentos	2.372.940.371,78	100,00%	2.070.006.568,63	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	15,80%	IMA	14,80%
Renda Variável	19,07%	IBOVESPA	22,28%
Carteira de Ações em Mercado (Própria)	0,00%	IBOVESPA	22,28%
FRG FIA Sharp	22,92%	IBOVESPA	22,28%
FRG FIA Claritas	17,51%	IBOVESPA	22,28%
Estruturado	(11,64%)	IHFA	9,31%
Exterior	11,15%	MSCI ACWI index (em reais)	3,95%
Imobiliário	38,22%	IFIX	15,50%
Operações com Participantes	6,61%	IPCA + 4,89% ^(*)	8,29%
Total	15,57%	IPCA + 4,89%	9,22%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do IPCA + 4,89% a.a. como benchmark do Segmento de Operações com Participantes foi apurada com defasagem de 2 (dois) meses, a partir de fev/2023. Em jan/2023, a meta de investimentos do Plano CD era IGP-DI + 4,89% a.a.

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no total	Partic. Total Terceirizado ^(**)
MULTIMERCADO/RENDA FIXA		1.926.430.179,02	81,18%	-
Fundos Exclusivos		1.926.430.179,02	81,18%	-
FRG Plano CD FI Multimercado	Real Grandeza	1.926.430.179,02	81,18%	-
ESTRUTURADO		235.928.042,03	9,94%	55,42%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia	BRZ Investimentos	1.157.184,33	0,05%	0,27%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia	DGF Investimentos	819.396,73	0,03%	0,19%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia	Ória Gestão de Recursos	1.285.549,62	0,05%	0,30%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	107.608,56	0,00%	0,03%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP	Pátria Investimentos	700.506,49	0,03%	0,16%
FOF FRG FIC FIM	Real Grandeza	231.857.796,30	9,77%	54,47%
EXTERIOR		51.573.522,00	2,17%	12,12%
Ishares S&P 500 IVVB11	Black Rock Brasil	51.573.522,00	2,17%	12,12%
IMOBILIÁRIO		7.949.200,00	0,33%	1,87%
FII Rio Bravo Renda Varejo	Rio Bravo Investimentos	7.949.200,00	0,33%	1,87%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA		130.225.320,11	5,49%	30,59%
FRG FIA Sharp	Sharp Capital	60.112.461,87	2,53%	14,12%
FRG FIA Claritas	Claritas Adm. de Recursos	70.112.858,24	2,95%	16,47%
Total		2.300.532.741,16	96,95%	-

(**) 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			2.372.940.371,78	100,00%
FRG PLANO CD FI MULTIMERCADO			1.926.430.179,02	81,18%
RENDA FIXA			1.599.223.542,54	67,39%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			1.546.167.758,35	65,16%
Notas do Tesouro Nacional			1.157.303.299,92	48,77%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			1.157.303.299,92	48,77%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)		29.757	126.710.819	5,34%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2025)		44.713	189.653.049	7,99%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2026)		10.000	43.531.840	1,83%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2028)		27.816	122.561.255	5,16%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2030)		14.653	65.312.977	2,75%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2033)		5.764	25.478.686	1,07%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		10.960	48.770.598	2,06%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2040)		7.409	33.800.867	1,42%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)		25.602	115.122.596	4,85%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)		62.327	286.327.828	12,07%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)		10.212	46.521.921	1,96%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2060)		4.850	22.432.590	0,95%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		3.586	31.078.272	1,31%
Operações Compromissadas (Adelic)		550.851	388.864.458	16,39%
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			52.030.118,09	2,19%
Letras Financeiras			52.030.118,09	2,19%
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)		7	20.429.378	0,86%
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)		5	12.394.884	0,52%
Bradesco (Vencimento: 04/09/2028)		9	19.205.856	0,81%
FRG CONSOLIDADOR REFIX FIM		1.000.000	1.025.666,10	0,04%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(27.527,15)	0,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			446.510.192,76	18,82%
RENDA VARIÁVEL			457.459.483,74	19,28%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA			130.225.320,11	5,49%
FRG FIA Sharp		14.892.981	60.112.461,87	2,53%
FRG FIA Claritas		39.351.204	70.112.858,24	2,95%
FRG CONSOLIDADOR RENDA VARIÁVEL FIM		2.799.051	327.234.163,63	13,79%
ESTRUTURADO			235.928.042,03	9,94%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia		1.257	1.157.184,33	0,05%
DGF FICPAC 2 FIP		1.282	819.396,73	0,03%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1		1.831	107.608,56	0,00%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP		2.177	700.506,49	0,03%
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia		1.237.291	1.285.549,62	0,05%
FOF FRG FIC FIM		2.195.787	231.857.796,30	9,77%
EXTERIOR			51.573.522,00	2,17%
Ishares S&P 500 IVVB11		200.200	51.573.522,00	2,17%
IMOBILIÁRIO			7.949.200,00	0,33%
FII Rio Bravo Renda Varejo (ex-Agências Caixa)		70.000	7.949.200	0,33%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			20.830.941,80	0,88%
Saldo de Empréstimos			20.208.891,99	0,85%
Valores a Pagar/Receber			622.049,81	0,03%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			3.166,82	0,00%