

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
3º TRIMESTRE DE 2019

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2019		2018		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	11.770.443.965,02	75,11%	11.552.068.711,97	81,22%	Até 100%
Renda Variável	2.839.267.653,98	18,12%	1.604.380.221,56	11,28%	Até 25%
Estruturado	182.803.424,92	1,17%	258.404.875,23	1,82%	Até 12%
Exterior	-	0,00%	-	0,00%	Até 4%
Imobiliário	617.432.057,02	3,94%	524.098.663,93	3,68%	Até 6%
Operações com Participantes	253.894.264,07	1,62%	273.420.882,49	1,92%	Até 4%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	7.807.864,62	0,05%	10.327.257,59	0,07%	-
Total de Investimentos	15.671.649.229,63	100,00%	14.222.700.612,77	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	15,20%	IMA	10,72%
Títulos a Mercado	18,33%	IMA	10,72%
Títulos na Curva	8,49%	INPC + 5,60%	6,91%
Renda Variável	18,35%	-	-
Carteira de Ações em Mercado (Própria)	17,72%	IBrX	20,50%
FRG FIA Western Asset	18,67%	IBrX	20,50%
FRG FIA Sharp	23,21%	IBrX	20,50%
FRG FIA FT	15,93%	IBrX	20,50%
Estruturado	2,56%	IMA-B + 2%	21,33%
Imobiliário	5,23%	IFIX	14,15%
Operações com Participantes	3,51%	INPC + 5,60% ^(*)	6,73%
Total	14,82%	INPC + 5,60%	6,91%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 5,60% a.a. como benchmark do Segmento de Operações com Participantes foi apurada com defasagem de 2 (dois) meses para o INPC.

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

Gestor	Saldo (R\$)	Participação no Total	Partic. Total Terceirizado ^(**)
MULTIMERCADO/RENDA FIXA	13.956.542.787,35	89,06%	-
Fundos Exclusivos	13.956.542.787,35	89,06%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	13.956.542.787,35	89,06%
ESTRUTURADO	182.803.424,92	1,17%	20,63%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia	BRZ Investimentos	24.339.866,20	0,16%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia	DGF Investimentos	11.217.553,87	0,07%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia	Ória Gestão de Recursos	38.716.408,68	0,25%
FIP Brasil Energia Multiestratégia	BTG Pactual	55.081.740,78	0,35%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	7.082.211,19	0,05%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP	Pátria Investimentos	46.365.644,20	0,30%
IMOBILIÁRIO	42.075.000,00	0,27%	4,75%
FIL Rio Bravo Renda Varejo	Rio Bravo Investimentos	42.075.000,00	0,27%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA	661.013.499,73	4,22%	74,62%
FRG FIA Western Asset	Western Asset Management	65.982.193,51	0,42%
FRG FIA Sharp	Sharp Capital	345.801.382,38	2,21%
FRG FIA FT	Franklin Templeton	249.229.923,84	1,59%
Total	14.842.434.712,00	94,71%	-

(**) 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			15.671.649.229,63	100,00%		
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADC			13.956.542.787,35	89,06%		
RENDA FIXA			11.770.443.965,02	75,11%		
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			11.328.025.172,54	72,28%		
Notas do Tesouro Nacional			9.940.504.487,60	63,43%		
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			6.274.016.064,41	40,03%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			310.730	1.169.528.301	7,46%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			570.967	2.484.569.990	15,85%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			191.258	882.887.347	5,63%	
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			23.204	102.320.993	0,65%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			199.718	1.519.783.157	9,70%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			59.638	69.825.006	0,45%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2027)			37.644	45.101.270	0,29%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2029)			-	-	0,00%	
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			3.666.488.423,19	23,40%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			9.223	28.994.981	0,19%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			326.916	928.884.418	5,93%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			241.997	717.460.063	4,58%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			3.399	10.498.415	0,07%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			242.593	728.299.207	4,65%	
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			71.854	293.614.970	1,87%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			150.159	869.713.004	5,55%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			99.165	89.023.366	0,57%	
Títulos da Dívida Agrária			28	2.926,43	0,00%	
Operações Compromissadas (Adelic)			1.775.688	1.387.517.758,51	8,85%	
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			442.418.792,48	2,82%		
Letras Financeiras			419.216.799,39	2,68%		
Bradesco (Vencimento: 08/09/2023)			13	33.245.953,21	0,21%	
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)			30	67.261.295,22	0,43%	
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)			25	49.506.535,92	0,32%	
Bradesco (Vencimento: 04/09/2028)			100	178.670.875,41	1,14%	
Bradesco (Vencimento: 09/10/2028)			60	90.532.139,63	0,58%	
Debêntures Não Conversíveis			15.794.226,94	0,10%		
Vale (Vencimento: 08/07/2050)			655.840	15.794.226,94	0,10%	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			7.407.766,15	0,05%		
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis			4.620	2.589.741,00	0,02%	
Proman - Produtores Energéticos de Manso			2.000	4.818.025,15	0,03%	
RENDA VARIÁVEL			2.178.253.954,25	13,90%		
Mercado à Vista			2.178.253.954,25	13,90%		
Azul			PN	395.832	19.676.808,72	0,13%
B3			ON	3.634.155	158.558.182,65	1,01%
Banco do Brasil			ON	2.665.659	121.260.827,91	0,77%
Bradesco			PN	5.997.366	205.798.270,72	1,31%
Brasil Seguridade			ON	1.305.503	45.731.770,09	0,29%
Banco Inter S.A.			UNT	61.483	3.489.160,25	0,02%
BR Distribuidora			ON	2.088.272	57.490.128,16	0,37%
BR Foods			ON	2.339.313	89.361.756,60	0,57%
B2W Companhia Global do Varejo			ON	633.707	30.639.733,45	0,20%
B2W Digital REC			ON	84.949	4.107.284,15	0,03%
CCR			ON	1.000.163	17.252.811,75	0,11%
Cesp			PNB	306.847	10.962.439,50	0,07%
Cemig			ON	348.320	5.538.288,00	0,04%
Cemig			PN	2.749.785	39.404.419,05	0,25%
CPFL Energia			ON	340.975	11.214.667,75	0,07%
CRFB			ON	704.139	14.822.125,95	0,09%
Copasa			ON	242.714	16.502.124,86	0,11%
CVC S.A.			ON	136.032	7.597.387,20	0,05%
Cyrela Real			ON	307.489	7.395.110,45	0,05%
Energisa			UNT	119.958	5.991.902,10	0,04%
Equatorial			ON	637.116	63.896.363,64	0,41%
Ez Tec Emp e Part			ON	327.730	19.722.846,00	0,13%
Hapvida			ON	875.795	47.161.560,75	0,30%
Hering			ON	285.844	9.924.503,68	0,06%
Hypera			ON	514.918	17.265.200,54	0,11%
IRB Brasil			ON	1.065.689	40.133.847,74	0,26%
Itausa			PN	6.291.816	82.926.134,88	0,53%
Itau Unibanco			PN	3.606.791	127.943.256,73	0,82%
Klabin			UNT	1.484.888	22.852.426,32	0,15%
Kroton			ON	1.911.055	21.365.594,90	0,14%

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
Light S.A.	ON	831.645	15.967.584,00	0,10%
Linx	ON	277.575	8.976.775,50	0,06%
Lojas Renner	ON	2.345.870	118.396.058,90	0,76%
Multiplan	ON	2.053.846	59.253.457,10	0,38%
Natura	ON	564.970	19.129.884,20	0,12%
Pão de Açúcar	PN	457.107	36.477.138,60	0,23%
Petrobras	ON	1.752.896	52.849.814,40	0,34%
Petrobras	PN	8.733.785	242.538.766,75	1,55%
Raiadrogasil	ON	313.223	30.009.895,63	0,19%
Rumo	ON	1.726.616	42.302.092,00	0,27%
Randon	PN	202.251	1.939.587,09	0,01%
Localiza	ON	2.252.314	102.390.194,44	0,65%
Sanepar	UNT	135.225	11.385.945,00	0,07%
Sul América	UNT	451.226	21.527.992,46	0,14%
Suzano	ON	800.570	26.939.180,50	0,17%
Totvs	ON	437.533	25.263.155,42	0,16%
Telefônica Brasil	PN	204.283	11.223.308,02	0,07%
VVAR Via Varejo	ON	995.285	7.882.657,20	0,05%
Weg	ON	735.185	17.813.532,55	0,11%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			7.844.868,07	0,05%
CARTEIRA PRÓPRIA			1.715.106.442,28	10,94%
RENDA VARIÁVEL			200,00	0,00%
Mercado à Vista			200,00	0,00%
Proman - Produtores Energéticos de Manso	ON	20.000	200,00	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA			661.013.499,73	4,22%
FRG FIA Western Asset		29.377.300	65.982.193,51	0,42%
FRG FIA Sharp		127.398.877	345.801.382,38	2,21%
FRG FIA FT		1.274.817	249.229.923,84	1,59%
ESTRUTURADO			182.803.424,92	1,17%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia		40.671	24.339.866	0,16%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia		14.300	11.217.554	0,07%
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia		23.285.289	38.716.409	0,25%
FIP Brasil Energia Multiestratégia		2.888	55.081.741	0,35%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1		44.756	7.082.211	0,05%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP		39.301	46.365.644	0,30%
IMOBILIÁRIC			617.432.057,02	3,94%
Certificados de Recebíveis Imobiliários			53.142.067,79	0,34%
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital		1	53.142.067,79	0,34%
FII Rio Bravo Renda Varejo (ex-Agências Caixa)		330.000	42.075.000	0,27%
Edificações de Uso Próprio			41.657.653,99	0,27%
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ			41.657.653,99	0,27%
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			468.031.695,44	2,99%
Rodovia Presidente Dutra, 238 - Rio de Janeiro - RJ			9.510.653,50	0,06%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ			149.636.334,47	0,95%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ			102.366.779,15	0,65%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ			206.517.928,32	1,32%
Edificações para Renda			2.066.605,94	0,01%
Ed Parque das Palmeiras, R. Omar T. Castro, L88/90 Q5 - Angra dos Reis - RJ			2.066.605,94	0,01%
Valores a Receber			10.542.619,58	0,07%
Valores a Pagar			(83.585,72)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			253.894.264,07	1,62%
Saldo de Empréstimos			275.043.217,21	1,76%
Valores a Pagar/Receber			(21.148.953,14)	-0,13%
OUTROS REALIZÁVEIS			-	0,00%
Valores a Receber			-	0,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(37.003,46)	0,00%