

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
1º TRIMESTRE DE 2016

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2016		2015		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	13.865.303.409,03	83,23%	8.588.622.694,74	76,05%	Até 100%
Renda Variável	1.740.374.610,01	10,45%	1.644.328.330,50	14,56%	Até 30%
Investimentos Estruturados	237.140.887,55	1,42%	231.449.068,14	2,05%	Até 18%
Investimentos no Exterior	-	0,00%	-	0,00%	Até 2%
Investimentos Imobiliários	560.652.974,68	3,37%	564.452.098,37	5,00%	Até 6%
Operações com Participantes	253.893.917,62	1,52%	254.421.912,18	2,25%	Até 6%
Caixa/Despesas a Pagar	2.441.249,69	0,01%	10.316.809,46	0,09%	-
Total de Investimentos	16.659.807.048,58	100,00%	11.293.590.913,39	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	9,58%	-	-
Títulos a Mercado	12,44%	IMA	7,28%
Títulos na Curva	4,54%	INPC + 5,70%	4,36%
Renda Variável	14,43%	-	-
Carteira de Mercado	14,60%	IBrX	13,92%
Carteira de Ativos Diversos	0,72%	IBrX	13,92%
FRG FIA - Q	8,62%	IBrX	13,92%
FRG FIA - GAP	14,88%	IBrX	13,92%
Investimentos Estruturados	2,25%	IMA-B + 2%	10,30%
Investimentos Imobiliários	1,58%	IMA	7,28%
Operações com Participantes	4,91%	INPC + 5,70% ^(*)	4,97%
Total	9,58%	INPC + 5,70%	4,36%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 5,70% 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		15.473.779.892,85	92,88%	-
Fundos Exclusivos		15.473.779.892,85	92,88%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	15.473.779.892,85	92,88%	-
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		237.140.887,55	1,42%	71,56%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP	BRZ Investimentos	25.108.777,37	0,15%	7,58%
DGF FIPAC 2 FIP	DGF Investimentos	9.242.300,62	0,06%	2,79%
DLM Brasil TI FIP	DLM Private Equity	21.190.638,05	0,13%	6,39%
FII Agências Caixa	Rio Bravo	32.340.000,00	0,19%	9,76%
FIP Brasil Energia	BTG Pactual	93.831.442,06	0,56%	28,31%
FIP Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	29.647.872,25	0,18%	8,95%
Mellon GTD FIP	ARGUCIACAPITAL	1.792.406,00	0,01%	0,54%
Pátria Real Estate III FIP	Pátria Investimentos	23.987.451,20	0,14%	7,24%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA		94.265.299,68	0,57%	28,44%
FRG FIA - Q	AZ QUEST Investimentos	53.857.986,21	0,32%	16,25%
FRG FIA - GAP	GAP Prudential LT	40.407.313,47	0,24%	12,19%
Total		15.805.186.080,08	94,87%	-

(**) 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			16.659.807.048,58	100,00%		
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADO			15.473.779.892,85	92,88%		
RENDA FIXA			13.825.304.353,04	82,99%		
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			13.464.533.560,30	80,82%		
Notas do Tesouro Nacional			13.121.639.898,10	78,76%		
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			9.891.748.820,01	59,37%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			310.730	5.377.969.245	32,28%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			570.967	1.589.527.168	9,54%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			331.258	903.685.286	5,42%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			190.691	512.483.090	3,08%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			82.698	226.267.955	1,36%	
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			23.204	83.544.882	0,50%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			199.718	1.117.676.481	6,71%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			59.638	49.867.495	0,30%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2027)			37.644	30.727.218	0,18%	
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			3.229.891.078,09	19,39%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			9.223	24.990.062	0,15%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			326.916	803.408.485	4,82%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			241.997	628.037.540	3,77%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			3.399	9.221.362	0,06%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			242.593	639.475.794	3,84%	
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			71.854	248.480.456	1,49%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			150.159	791.903.949	4,75%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			99.165	84.373.430	0,51%	
Títulos da Dívida Agrária			3.339	309.232,13	0,00%	
Operações Compromissadas (Adelic)			407.947	342.584.430,07	2,06%	
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			360.770.792,74	2,17%		
Letras Financeiras			44.568.533,67	0,27%		
Bradesco (Vencimento: 08/09/2023)			13	15.530.100,76	0,09%	
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)			30	29.038.432,91	0,17%	
Letras Financeiras Subordinadas			251.615.943,62	1,51%		
Bradesco (Vencimento: 06/02/2018)			76	129.897.609,45	0,78%	
Itaú (Vencimento: 06/02/2018)			76	121.718.334,17	0,73%	
Debêntures Não Conversíveis			64.586.315,45	0,39%		
BNDES Participações (Vencimento: 15/01/2017)			42.238	61.625.579,88	0,37%	
Vale (Vencimento: 08/07/2050)			655.840	2.960.735,57	0,02%	
RENDA VARIÁVEL			1.646.109.110,33	9,88%		
Mercado à Vista			1.637.773.303,21	9,83%		
AES Elpa			ON	333.918	3.305.788,20	0,02%
Bradesco			PN	4.963.620	134.365.193,40	0,81%
Brasil Seguridade			ON	2.946.126	87.499.942,20	0,53%
BRF - Brasil Foods			ON	1.822.267	93.500.519,77	0,56%
BM&FBovespa			ON	7.212.873	110.933.986,74	0,67%
CCR			ON	3.626.025	50.873.130,75	0,31%
Cielo			ON	3.507.776	122.666.926,72	0,74%
CPFL Energia			ON	2.812.300	55.121.080,00	0,33%
Fibra			ON	1.371.138	41.600.326,92	0,25%
Itausa			PN	15.165.854	123.905.027,18	0,74%
Itau Unibanco			PN	8.500.863	265.311.934,23	1,59%
Klabin			UNT	2.998.065	58.072.519,05	0,35%
Kroton			ON	2.756.617	31.645.963,16	0,19%
Lojas Renner			ON	1.396.958	29.042.756,82	0,17%
Petrobras			ON	5.162.200	54.874.186,00	0,33%
Petrobras			PN	6.862.225	57.299.578,75	0,34%
Raíadrogasil			ON	1.857.542	96.963.692,40	0,58%
Tran Paulista			PN	961.632	46.494.907,20	0,28%
Ultrapar Participações			ON	1.559.128	108.811.543,12	0,65%
Vivt - Telef Brasil			PN	851.430	38.518.693,20	0,23%
Weg			ON	1.924.740	26.965.607,40	0,16%
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			8.335.807,12	0,05%		
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis			4.620	2.589.741,00	0,02%	
Proman - Produtores Energéticos de Manso			2.000	5.746.066,12	0,03%	
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			2.366.429,48	0,01%		

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			16.659.807.048,58	100,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			1.186.027.155,73	7,12%
RENDA FIXA			39.999.055,99	0,24%
Certificados de Recebíveis Imobiliários			39.999.055,99	0,24%
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital			39.999.055,99	0,24%
RENDA VARIÁVEL			200,00	0,00%
Mercado à Vista			200,00	0,00%
Proman - Produtores Energéticos de Manso			200,00	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA			94.265.299,68	0,57%
FRG FIA - Q			53.857.986,21	0,32%
FRG FIA - GAP			40.407.313,47	0,24%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			237.140.887,55	1,42%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP			25.108.777,37	0,15%
DGF FIPAC 2 FIP			9.242.300,62	0,06%
DLM Brasil TI FIP			21.190.638,05	0,13%
FII Agências Caixa			32.340.000,00	0,19%
FIP Brasil Energia			93.831.442,06	0,56%
FIP Brasil Petróleo 1			29.647.872,25	0,18%
Mellon GTD FIP			1.792.406,00	0,01%
Pátria Real Estate III FIP			23.987.451,20	0,14%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			560.652.974,68	3,37%
Edificações de Uso Próprio			45.846.262,38	0,28%
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ			45.846.262,38	0,28%
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			504.890.290,08	3,03%
Rodovia Presidente Dutra, 238 - Rio de Janeiro - RJ			14.225.810,01	0,09%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ			160.585.719,85	0,96%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ			109.795.453,58	0,66%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ			220.283.306,64	1,32%
Edificações para Renda			5.915.292,56	0,04%
Ed Parque das Palmeiras, R. Omar T. Castro, L88/90 Q5 - Angra dos Reis - RJ			5.915.292,56	0,04%
Valores a Receber			4.118.289,66	0,02%
Valores a Pagar			(117.160,00)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			253.893.917,62	1,52%
Valores a Receber			257.690.343,17	1,55%
Valores a Pagar			(3.796.425,55)	-0,02%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			74.820,21	0,00%
Valores a Receber			74.820,21	0,04%
Valores a Pagar			-	0,00%