

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
4º TRIMESTRE DE 2020

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2020		2019		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	11.843.445.780,78	72,73%	11.448.025.946,82	71,41%	Até 100%
Renda Variável	3.510.291.593,68	21,56%	3.504.331.411,25	21,86%	Até 30%
Estruturado	109.874.770,50	0,67%	188.230.695,91	1,17%	Até 12%
Exterior	-	0,00%	-	0,00%	Até 4%
Imobiliário	594.367.095,88	3,65%	630.593.728,33	3,93%	Até 6%
Operações com Participantes	215.807.126,60	1,33%	247.189.195,13	1,54%	Até 4%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	9.407.498,13	0,06%	13.197.555,91	0,08%	-
Total de Investimentos	16.283.193.865,57	100,00%	16.031.568.533,35	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	11,95%	IMA	5,34%
Títulos a Mercado	8,96%	IMA	5,34%
Títulos na Curva	18,12%	INPC + 5,00%	10,88%
Renda Variável	1,43%	-	-
Carteira de Ações em Mercado (Própria)	0,70%	IBrX	3,50%
FRG FIA Western Asset	1,26%	IBrX	3,50%
FRG FIA Sharp	8,31%	IBrX	3,50%
FRG FIA FT	4,39%	IBrX	3,50%
FRG FIA Claritas(**)	44,42%	IBrX(**)	63,71%
Estruturado	(16,30%)	IMA-B + 2%	8,53%
Imobiliário	(0,56%)	IFIX	(10,24%)
Operações com Participantes	11,52%	INPC + 5,00% ^(*)	10,27%
Total	9,13%	INPC + 5,00%	10,88%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 5,60% a.a. de jan até mar /2020 e INPC + 5,00% a.a. a partir de abr/2020, como benchmark do Segmento de Operações com Participantes foi apurada com defasagem de 2 (dois) meses para o INPC.

(**) O FRG FIA Claritas entrou na carteira em 12/03/2020. Consideramos esta data para o cálculo da rentabilidade do Fundo, bem como o comparativo com o seu Benchmark (IBrX), para o ano de 2020.

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no Total	Partic. Total Terceirizado ^(**)
MULTIMERCADO/RENDA FIXA		14.571.378.563,01	89,49%	-
Fundos Exclusivos		14.571.378.563,01	89,49%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	14.571.378.563,01	89,49%	-
ESTRUTURADO		109.874.770,50	0,67%	11,68%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia	BRZ Investimentos	19.784.019,77	0,12%	2,10%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia	DGF Investimentos	12.117.183,81	0,07%	1,29%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia	Ória Gestão de Recursos	41.315.818,09	0,25%	4,39%
FIP Brasil Energia Multiestratégia	BTG Pactual	1.331.797,12	0,01%	0,14%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	5.239.005,16	0,03%	0,56%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP	Pátria Investimentos	30.086.946,55	0,18%	3,20%
IMOBILIÁRIO		38.940.000,00	0,24%	4,14%
FII Rio Bravo Renda Varejo	Rio Bravo Investimentos	38.940.000,00	0,24%	4,14%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA		791.796.533,57	4,86%	84,18%
FRG FIA Western Asset	Western Asset Management	74.257.341,10	0,46%	7,89%
FRG FIA Sharp	Sharp Capital	458.749.822,44	2,82%	48,77%
FRG FIA FT	Franklin Templeton	88.590.488,93	0,54%	9,42%
FRG FIA Claritas	Claritas Adm. de Recursos	170.198.881,10	1,05%	18,09%
Total		15.511.989.867,08	95,26%	-

(**) 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			16.283.193.865,57	100,00%		
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADO			14.571.378.563,01	89,49%		
RENDA FIXA			11.843.445.780,78	72,73%		
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			11.349.490.285,00	69,70%		
Notas do Tesouro Nacional			8.919.461.775,06	54,78%		
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			4.835.995.669,33	29,70%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			310.730	1.248.569.147	7,67%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			158.370	715.803.513	4,40%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			191.258	884.030.933	5,43%	
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			23.204	120.774.898	0,74%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			199.718	1.748.621.606	10,74%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			59.638	71.877.590	0,44%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2027)			37.644	46.317.982	0,28%	
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			4.083.466.105,73	25,08%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			9.223	31.344.679	0,19%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			326.916	971.453.784	5,97%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			241.997	746.984.538	4,59%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			3.399	11.265.010	0,07%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			242.593	757.434.243	4,65%	
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			71.854	370.191.428	2,27%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			150.159	1.101.011.236	6,76%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			99.165	93.781.188	0,58%	
Operações Compromissadas (Adelic)			248.935	2.430.028.510	14,92%	
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			493.955.495,78	3,03%		
Letras Financeiras			455.716.754,07	2,80%		
Bradesco (Vencimento: 08/09/2023)			13	37.751.237,43	0,23%	
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)			30	75.233.469,41	0,46%	
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)			25	54.541.101,51	0,33%	
Bradesco (Vencimento: 04/09/2028)			100	191.318.915,22	1,17%	
Bradesco (Vencimento: 09/10/2028)			60	96.872.030,50	0,59%	
Debêntures Não Conversíveis			31.347.467,31	0,19%		
Vale (Vencimento: 08/07/2050)			655.840	31.347.467,31	0,19%	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			6.891.274,40	0,04%		
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis			4.620	2.589.741,00	0,02%	
Proman - Produtores Energéticos de Manso			2.000	4.301.533,40	0,03%	
RENDA VARIÁVEL			2.718.494.860,11	16,70%		
Mercado à Vista			2.718.494.860,11	16,70%		
Alpargatas			PN	601.523	25.263.966,00	0,16%
Aliansce Shopping Centers S.A.			ON	215.380	6.282.634,60	0,04%
B3			ON	3.500.887	216.984.976,26	1,33%
Brasil			ON	1.432.942	55.598.149,60	0,34%
Bradesco			PN	4.860.152	131.904.525,28	0,81%
Petrobras BR			ON	981.114	21.712.052,82	0,13%
B2W Digital			ON	163.627	12.371.837,47	0,08%
CCR S.A.			ON	1.127.146	15.182.656,62	0,09%
CPFL Energia			ON	1.775.857	57.804.145,35	0,35%
Cia Siderúrgica Nacional			ON	149.781	4.770.524,85	0,03%
Cyrela Realt			ON	1.213.992	35.788.484,16	0,22%
Duratex			ON	590.296	11.298.265,44	0,07%
Equatorial			ON	4.637.291	107.399.659,56	0,66%
Eztec			ON	581.523	24.947.336,70	0,15%
Gerdau			PN	383.260	9.370.707,00	0,06%
Notre Dame Intermédica			ON	511.036	40.034.560,24	0,25%
Gerdau Metalúrgica			PN	1.515.331	17.062.627,06	0,10%
Hapvida			ON	3.782.650	57.723.239,00	0,35%
Hypera			ON	2.066.014	70.760.979,50	0,43%
Itausa			PN	8.310.904	97.486.903,92	0,60%
ItauUnibanco			PN	5.009.036	158.435.808,68	0,97%
Klabin S.A.			UNT	1.210.924	32.053.158,28	0,20%
Lojas Americanas			PN	581.523	15.288.239,67	0,09%
Locamerica			ON	620.054	18.173.782,74	0,11%
Lojas Renner			ON	1.802.284	78.471.445,36	0,48%
M.Diasbranco			ON	442.999	15.088.545,94	0,09%
Magaz Luiza			ON	3.101.328	77.378.133,60	0,48%
Movida			ON	1.127.227	23.277.237,55	0,14%
Marfrig			ON	1.277.457	18.535.901,07	0,11%
Multiplan			ON	1.052.062	24.755.018,86	0,15%
Grupo Natura			ON	2.301.655	120.836.887,50	0,74%
Pão de Açúcar-CBD			ON	79.296	5.951.164,80	0,04%

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
Petrobras	ON	984.480	28.402.248,00	0,17%
Petrobras	PN	7.122.913	201.863.354,42	1,24%
RaiaDrogasil	ON	850.640	21.300.025,60	0,13%
Rumo S.A.	ON	360.390	6.933.903,60	0,04%
Randon Part	PN	810.368	13.030.717,44	0,08%
Localiza	ON	1.585.025	109.287.473,75	0,67%
Sul America	UNT	1.453.781	64.475.187,35	0,40%
Suzano S.A.	ON	867.880	50.805.695,20	0,31%
Tim Part S.A.	ON	1.364.676	19.992.503,40	0,12%
Totvs	ON	589.269	16.923.805,68	0,10%
Ultrapar	ON	1.466.543	34.815.730,82	0,21%
Vale	ON	4.858.657	424.889.554,65	2,61%
Viavarejo	ON	2.158.748	34.885.367,68	0,21%
Weg	ON	847.838	64.215.250,12	0,39%
Yduqs Part	ON	567.451	18.680.486,92	0,11%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			9.437.922,12	0,06%
CARTEIRA PRÓPRIA			1.711.815.302,56	10,51%
RENTA 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			791.796.533,57	4,86%
FRG FIA Western Asset		29.377.300	74.257.341,10	0,46%
FRG FIA Sharp		140.088.361	458.749.822,44	2,82%
FRG FIA FT		390.637	88.590.488,93	0,54%
FRG FIA Claritas		117.852.476	170.198.881,10	1,05%
ESTRUTURADO			109.874.770,50	0,67%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia		41.163	19.784.020	0,12%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia		14.437	12.117.184	0,07%
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia		23.285.289	41.315.818	0,25%
FIP Brasil Energia Multiestratégia		2.888	1.331.797	0,01%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1		45.044	5.239.005	0,03%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP		41.986	30.086.947	0,18%
IMOBILIÁRIO			594.367.095,88	3,65%
Certificados de Recebíveis Imobiliários			58.392.348,48	0,36%
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital		1	58.392.348,48	0,36%
FII Rio Bravo Renda Varejo (ex-Agências Caixa)		330.000	38.940.000	0,24%
Edificações de Uso Próprio			32.488.927,57	0,20%
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ			32.488.927,57	0,20%
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			446.121.187,78	2,74%
Rodovia Presidente Dutra, 238 - Rio de Janeiro - RJ			9.195.075,94	0,06%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ			143.016.891,94	0,88%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ			97.456.411,10	0,60%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ			196.452.808,80	1,21%
Edificações para Renda			1.620.157,04	0,01%
Ed Parque das Palmeiras, R. Omar T. Castro, L88/90 Q5 - Angra dos Reis - RJ			1.620.157,04	0,01%
Valores a Receber			17.160.735,94	0,11%
Valores a Pagar			(356.260,93)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			215.807.126,60	1,33%
Saldo de Empréstimos			239.175.836,84	1,47%
Valores a Pagar/Receber			(23.368.710,24)	-0,14%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(30.423,99)	0,00%