

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
1º TRIMESTRE DE 2021

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2021		2020		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	11.929.781.590,64	73,63%	11.162.106.667,78	77,59%	Até 100%
Renda Variável	3.356.542.514,02	20,72%	2.173.946.578,05	15,11%	Até 35%
Estruturado	104.593.645,37	0,65%	182.252.894,30	1,27%	Até 19%
Exterior	-	0,00%	-	0,00%	Até 5%
Imobiliário	594.578.176,74	3,67%	614.060.616,90	4,27%	Até 10%
Operações com Participantes	208.964.784,49	1,29%	242.090.010,57	1,68%	Até 4%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	8.037.307,30	0,05%	10.946.104,75	0,08%	-
Total de Investimentos	16.202.498.018,56	100,00%	14.385.402.872,35	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	2,63%	IMA	(1,32%)
Títulos a Mercado	6,14%	IMA	(1,32%)
Títulos na Curva	0,79%	INPC + 5,00%	3,21%
Renda Variável	(3,42%)	-	-
Carteira de Ações em Mercado (Própria)	(3,92%)	IBrX	(0,72%)
FRG FIA Sharp	(1,84%)	IBrX	(0,72%)
FRG FIA Western Asset	(5,19%)	IBrX	(0,72%)
FRG FIA FT	(0,95%)	IBrX	(0,72%)
FRG FIA Claritas	(0,73%)	IBrX	(0,72%)
Estruturado	(4,55%)	IMA-B + 2%	(2,32%)
Imobiliário	(1,11%)	IFIX	(0,81%)
Operações com Participantes	3,47%	INPC + 5,00% ^(*)	3,96%
Total	1,13%	INPC + 5,00%	3,21%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 5,00% 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		14.517.000.090,87	89,60%	-
Fundos Exclusivos		14.517.000.090,87	89,60%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	14.517.000.090,87	89,60%	-
ESTRUTURADO		104.593.645,37	0,65%	11,39%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia	BRZ Investimentos	19.253.147,20	0,12%	2,10%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia	DGF Investimentos	12.079.892,87	0,07%	1,32%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia	Ória Gestão de Recursos	37.223.467,75	0,23%	4,05%
FIP Brasil Energia Multiestratégia	BTG Pactual	-	0,00%	0,00%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	4.328.629,87	0,03%	0,47%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP	Pátria Investimentos	31.708.507,68	0,20%	3,45%
IMOBILIÁRIO		36.531.000,00	0,23%	3,98%
FII Rio Bravo Renda Varejo	Rio Bravo Investimentos	36.531.000,00	0,23%	3,98%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA		777.396.025,55	4,80%	84,64%
FRG FIA Sharp	Sharp Capital	450.296.568,51	2,78%	49,02%
FRG FIA Western Asset	Western Asset Management	70.401.599,90	0,43%	7,66%
FRG FIA FT	Franklin Templeton	87.744.582,43	0,54%	9,55%
FRG FIA Claritas	Claritas Adm. de Recursos	168.953.274,71	1,04%	18,39%
Total		15.435.520.761,79	95,27%	-

(**) 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			16.202.498.018,56	100,00%		
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADC			14.517.000.090,87	89,60%		
RENTA FIXA			11.929.781.590,64	73,63%		
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			11.468.505.656,98	70,78%		
Notas do Tesouro Nacional			9.102.906.445,61	56,18%		
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			4.822.537.371,64	29,76%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			310.730	1.198.979.833	7,40%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			158.370	684.334.496	4,22%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			191.258	844.555.737	5,21%	
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			23.204	131.414.749	0,81%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			199.718	1.858.285.888	11,47%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			59.638	64.466.479	0,40%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2027)			37.644	40.500.190	0,25%	
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			4.280.369.073,97	26,42%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			9.223	31.664.287	0,20%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			326.916	1.012.815.878	6,25%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			241.997	777.508.222	4,80%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			3.399	11.357.341	0,07%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			242.593	788.039.046	4,86%	
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			71.854	406.805.918	2,51%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			150.159	1.160.441.441	7,16%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			99.165	91.736.940	0,57%	
Operações Compromissadas (Adelic)			2.399.313	2.365.599.211	14,60%	
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			461.275.933,66	2,85%		
Letras Financeiras			415.531.074,51	2,56%		
Bradesco (Vencimento: 08/09/2023)			13	36.211.932,67	0,22%	
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)			30	71.173.824,16	0,44%	
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)			25	49.450.241,35	0,31%	
Bradesco (Vencimento: 04/09/2028)			100	171.813.219,60	1,06%	
Bradesco (Vencimento: 09/10/2028)			60	86.881.856,73	0,54%	
Debêntures Não Conversíveis			38.965.178,60	0,24%		
Vale (Vencimento: 08/07/2050)			655.840	38.965.178,60	0,24%	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			6.779.680,55	0,04%		
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis			4.620	2.589.741,00	0,02%	
Proman - Produtores Energéticos de Manso			2.000	4.189.939,55	0,03%	
RENTA VARIÁVEL			2.579.146.288,47	15,92%		
Mercado à Vista			2.579.146.288,47	15,92%		
Alpargatas			PN	907.369	33.427.473,96	0,21%
B3			ON	3.589.226	196.043.524,12	1,21%
Brasil			ON	1.186.312	36.123.200,40	0,22%
Bradesco			PN	4.331.740	115.960.679,80	0,72%
Petrobras BR			ON	981.114	21.662.997,12	0,13%
B2W Digital			ON	163.627	9.940.340,25	0,06%
CCR S.A.			ON	1.127.146	14.562.726,32	0,09%
CPFL Energia			ON	1.775.857	54.021.569,94	0,33%
Cia Siderúrgica Nacional			ON	251.132	9.517.902,80	0,06%
Cyrela Realt			ON	976.189	24.063.058,85	0,15%
Duratex			ON	281.977	5.270.150,13	0,03%
Equatorial			ON	3.800.390	94.249.672,00	0,58%
Eztec			ON	740.190	23.723.089,50	0,15%
Gerdau			PN	612.384	18.506.244,48	0,11%
Notre Dame Intermédica			ON	1.061.843	87.920.600,40	0,54%
Hapvida			ON	1.229.198	18.290.466,24	0,11%
Hypera			ON	2.171.834	69.563.843,02	0,43%
Itausa			PN	8.619.902	88.957.388,64	0,55%
ItauUnibanco			PN	4.568.726	127.787.266,22	0,79%
Jhsf Part.			ON	1.453.978	10.119.686,88	0,06%
Klabin			UNT	1.210.924	33.457.830,12	0,21%
Lojas Americanas			PN	235.096	5.256.746,56	0,03%
Locamerica			ON	215.757	5.346.458,46	0,03%
Lojas Renner			ON	1.925.799	82.019.779,41	0,51%
Locaweb			ON	114.556	2.617.604,60	0,02%
Magaz Luiza			ON	2.793.080	56.531.939,20	0,35%
Movida			ON	1.251.137	20.956.544,75	0,13%
Multiplan			ON	898.216	21.997.309,84	0,14%
Natura			ON	2.301.655	110.801.671,70	0,68%
Pão de Açúcar-CBD			ON	79.296	2.631.041,28	0,02%
Petrobras			ON	984.480	23.568.451,20	0,15%
Petrobras			PN	7.475.894	180.169.045,40	1,11%

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
Petrorio	ON	290.796	26.834.654,88	0,17%
RaiaDrogasil	ON	850.640	21.317.038,40	0,13%
Rumo S.A.	ON	360.390	7.297.897,50	0,05%
Randon Part	PN	810.368	11.102.041,60	0,07%
Localiza	ON	1.840.647	109.941.845,31	0,68%
Sul America	UNT	1.541.672	52.678.932,24	0,33%
Suzano S.A.	ON	1.379.071	94.535.317,05	0,58%
Tim Part S.A.	ON	1.364.676	17.290.444,92	0,11%
Totvs	ON	370.658	10.723.135,94	0,07%
Ultrapar	ON	955.517	20.266.515,57	0,13%
Vale	ON	5.123.170	501.916.964,90	3,10%
Viavarejo	ON	1.806.444	21.803.779,08	0,13%
Weg	ON	847.838	63.214.801,28	0,39%
Yduqs	ON	567.451	15.156.616,21	0,09%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			8.072.211,76	0,05%
CARTEIRA PRÓPRIA			1.685.497.927,69	10,40%
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			777.396.025,55	4,80%
FRG FIA Western Asset		29.377.300	70.401.599,90	0,43%
FRG FIA Sharp		140.088.361	450.296.568,51	2,78%
FRG FIA FT		390.637	87.744.582,43	0,54%
FRG FIA Claritas		117.852.476	168.953.274,71	1,04%
ESTRUTURADO			104.593.645,37	0,65%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia		41.163	19.253.147	0,12%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia		14.437	12.079.893	0,07%
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia		23.285.289	37.223.468	0,23%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1		45.044	4.328.630	0,03%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP		43.534	31.708.508	0,20%
IMOBILIÁRIC			594.578.176,74	3,67%
Certificados de Recebíveis Imobiliários			59.467.495,39	0,37%
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital		1	59.467.495,39	0,37%
FII Rio Bravo Renda Varejo (ex-Agências Caixa)		330.000	36.531.000	0,23%
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	2,75%
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			1.540.143,44	0,01%
Ed Parque das Palmeiras, R. Omar T. Castro, L88/90 Q5 - Angra dos Reis - RJ			1.540.143,44	0,01%
Valores a Receber			18.935.409,48	0,12%
Valores a Pagar			(505.986,92)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			208.964.784,49	1,29%
Saldo de Empréstimos			208.295.440,20	1,29%
Valores a Pagar/Receber			669.344,29	0,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(34.904,46)	0,00%