

**FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE CONTRIBUIÇÃO DEFINIDA
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
3º TRIMESTRE DE 2023**

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2023		2022		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	1.545.988.883,35	68,62%	1.527.982.728,29	73,82%	Até 100%
Renda Variável	400.022.150,01	17,76%	495.051.376,87	23,92%	Até 30%
Estruturado	228.604.574,93	10,15%	4.641.259,91	0,22%	Até 15%
Exterior	47.805.758,00	2,12%	-	-	Até 10%
Imobiliário	7.948.500,00	0,35%	6.455.400,00	0,31%	Até 12%
Operações com Participantes	22.529.866,15	1,00%	35.292.413,50	1,70%	Até 5%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	54.842,43	0,00%	583.390,06	0,03%	-
Total de Investimentos	2.252.954.574,87	100,00%	2.070.006.568,63	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	10,82%	IMA	10,59%
Renda Variável	5,96%	IBOVESPA	6,22%
Carteira de Ações em Mercado (Própria)	0,00%	IBOVESPA	6,22%
FRG FIA Sharp	8,23%	IBOVESPA	6,22%
FRG FIA Claritas	5,57%	IBOVESPA	6,22%
Estruturado	(11,08%)	IHFA	4,77%
Exterior	3,03%	MSCI ACWI index (em reais)	(0,96%)
Imobiliário	34,55%	IFIX	12,28%
Operações com Participantes	2,47%	IPCA + 4,89% ^(*)	6,22%
Total	8,85%	IPCA + 4,89%	6,77%

(*) 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/RV		1.546.040.513,13	68,62%	-
Fundos Exclusivos		1.546.040.513,13	68,62%	-
FRG Plano CD FI Multimercado	Real Grandeza	1.546.040.513,13	68,62%	-
FRG Consol Refix FIM	Real Grandeza	1.000.000,00	0,04%	-
FRG Consolíd FIM RV	Real Grandeza	1.000.000,00	0,04%	-
ESTRUTURADO		228.604.574,93	10,15%	33,45%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia	BRZ Investimentos	1.158.168,74	0,05%	0,17%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia	DGF Investimentos	820.574,48	0,04%	0,12%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia	Ória Gestão de Recursos	1.280.195,48	0,06%	0,19%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	108.050,45	0,00%	0,02%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP	Pátria Investimentos	728.890,02	0,03%	0,11%
FOF FRG FIC FIM	Real Grandeza	224.508.695,76	9,97%	32,85%
EXTERIOR		47.805.758,00	2,12%	7,52%
Ishares S&P 500 IVVB11	Black Rock Brasil	47.805.758,00	2,12%	7,52%
IMOBILIÁRIO		7.948.500,00	0,35%	1,16%
FII Rio Bravo Renda Varejo	Rio Bravo Investimentos	7.948.500,00	0,35%	1,16%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA		115.914.955,51	5,15%	16,96%
FRG FIA Sharp	Sharp Capital	52.926.443,82	2,35%	7,74%
FRG FIA Claritas	Claritas Adm. de Recursos	62.988.511,69	2,80%	9,22%
FUNDO DE ÍNDICE - ETF		283.107.194,50	12,57%	41,43%
Ishares BOVA11	Black Rock Brasil	195.702.769,05	8,69%	28,64%
It Now BOVV11	Banco Itaú S/A	87.404.425,45	3,88%	12,79%
Total		2.181.615.738,07	96,83%	-

(**) 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			2.252.954.574,87	100,00%
FRG PLANO CD FI MULTIMERCADO			1.546.040.513,13	68,62%
RENDA FIXA			1.545.988.883,35	68,62%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			1.495.722.377,21	66,39%
Notas do Tesouro Nacional			1.113.531.725,47	49,43%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			1.113.531.725,47	49,43%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)		29.757	123.967.856	5,50%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2025)		44.713	190.324.682,95	8,45%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2026)		10.000	42.193.055	1,87%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2028)		27.816	118.038.483	5,24%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2030)		14.653	62.648.634	2,78%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2033)		5.764	24.983.830	1,11%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		10.960	47.697.347	2,12%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2040)		7.409	31.712.491	1,41%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)		25.602	110.963.110	4,93%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)		62.327	265.935.571	11,80%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)		10.212	44.214.315	1,96%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2060)		4.850	20.679.725	0,92%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		3.586	30.172.626	1,34%
Operações Compromissadas (Adelic)		379.588	382.190.652	16,96%
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			49.266.506,14	2,19%
Letras Financeiras			49.266.506,14	2,19%
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)		7	19.796.801	0,88%
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)		5	11.745.504	0,52%
Bradesco (Vencimento: 04/09/2028)		9	17.724.201	0,79%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO - FIM			1.000.000,00	0,04%
FRG Consol Refix FIM		1.000.000	1.000.000,00	0,04%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			51.629,78	0,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			706.914.061,74	31,38%
RENDA VARIÁVEL			400.022.150,01	17,76%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA			115.914.955,51	5,15%
FRG FIA Sharp		14.892.981	52.926.443,82	2,35%
FRG FIA Claritas		39.351.204	62.988.511,69	2,80%
FUNDO DE ÍNDICE - ETF			283.107.194,50	12,57%
Ishares BOVA11		1.729.587	195.702.769,05	8,69%
It Now BOVV11		737.279	87.404.425,45	3,88%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO - FIM			1.000.000,00	0,04%
FRG Consolid FIM RV		10.000	1.000.000,00	0,04%
ESTRUTURADO			228.604.574,93	10,15%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia		1.257	1.158.168,74	0,05%
DGF FICPAC 2 FIP		1.282	820.574,48	0,04%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1		1.831	108.050,45	0,00%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP		2.177	728.890,02	0,03%
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia		1.237.291	1.280.195,48	0,06%
FOF FRG FIC FIM		2.195.787	224.508.695,76	9,97%
EXTERIOR			47.805.758,00	2,12%
Ishares S&P 500 IVVB11		200.200	47.805.758,00	2,12%
IMOBILIÁRIO			7.948.500,00	0,35%
FII Rio Bravo Renda Varejo (ex-Agências Caixa)		70.000	7.948.500	0,35%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			22.529.866,15	1,00%
Saldo de Empréstimos			21.903.589,14	0,97%
Valores a Pagar/Receber			626.277,01	0,03%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			3.212,65	0,00%