

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
3º TRIMESTRE DE 2024

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2024		2023		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	14.273.646.183,86	90,18%	14.540.613.690,80	91,15%	Até 100%
Renda Variável	368.510.979,33	2,33%	485.815.944,36	3,05%	Até 10%
Estruturado	387.033.693,37	2,45%	263.690.087,46	1,65%	Até 10%
Exterior	331.519.117,57	2,09%	-	0,00%	Até 10%
Imobiliário	395.591.488,29	2,50%	443.782.293,16	2,78%	Até 10%
Operações com Participantes	72.003.390,08	0,45%	105.629.974,76	0,66%	Até 2%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(161.447,84)	0,00%	112.725.716,30	0,71%	-
Total de Investimentos	15.828.143.404,68	100,00%	15.952.257.706,84	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	7,72%	IMA	4,99%
Títulos a Mercado	7,22%	IMA	4,99%
Títulos na Curva	8,44%	INPC + 4,98%	7,13%
Renda Variável	(3,19%)	IBOVESPA	(1,77%)
Exterior	13,07%	USD	12,53%
Estruturado	(2,14%)	IHFA	3,62%
Imobiliário	(3,25%)	IFIX	(0,16%)
Operações com Participantes	8,07%	INPC + 4,98% ^(*)	7,44%
Total	5,66%	INPC + 4,98%	7,13%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 4,98% a.a. como benchmark do Segmento de Operações com Participantes foi apurada com defasagem de 2 (dois) meses.

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no Total	Partic. Total Terceirizado ^(**)
MULTIMERCADO/RENDA FIXA		15.280.650.965,80	96,54%	-
Fundos Exclusivos		15.280.650.965,80	96,54%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	15.280.650.965,80	96,54%	-
ESTRUTURADO		79.946.157,03	0,51%	100,00%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia	BRZ Investimentos	36.305.249,57	0,23%	45,41%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia	DGF Investimentos	8.983.437,26	0,06%	11,24%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia	Ória Gestão de Recursos	25.550.479,11	0,16%	31,96%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	771.607,03	0,00%	0,97%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP	Pátria Investimentos	8.335.384,06	0,05%	10,43%
Total		15.360.597.122,83	97,05%	-

(**) 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			15.828.143.404,68	100,00%	
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADO			15.280.650.965,80	96,54%	
RENTA FIXA			14.273.646.183,86	90,18%	
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			12.202.604.772,03	77,09%	
Notas do Tesouro Nacional		2.416.579	10.948.576.849,87	69,17%	
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")		196.140	1.265.213.252,11	7,99%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2026)		90.000	386.676.284	2,44%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		106.140	878.536.968	5,55%	
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")		2.220.439	9.683.363.597,76	61,18%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2028)		103.751	458.138.805	2,89%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2030)		63.932	285.790.406	1,81%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2032)		65.650	283.239.612	1,79%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2033)		139.236	616.103.511	3,89%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		524.146	2.158.597.983	13,64%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2040)		318.991	1.425.305.569	9,00%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)		330.497	1.355.842.152	8,57%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)		139.999	609.246.892	3,85%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)		150.593	602.004.103	3,80%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2060)		134.320	565.891.122	3,58%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		150.159	1.222.519.440	7,72%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)		99.165	100.684.002	0,64%	
BEM FI RF SIMPL TPF		281.815.674	1.254.027.922,16	7,92%	
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			6.206.537,83	0,04%	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros		6.620	6.206.537,83	0,04%	
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis		4.620	2.606.458	0,02%	
Proman - Produtores Energéticos de Manso		2.000	3.600.079	0,02%	
FRG Consolidador Refix FIM		1.951.430.610	2.013.127.820,35	12,72%	
FRG FIF MULT CP		500.000	51.707.053,65	0,33%	
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(112.651,32)	0,00%	
RENTA VARIÁVEL			3.298.739	368.510.779,33	2,33%
FRG Consolidador RV FIM		3.298.739	368.510.779,33	2,33%	
ESTRUTURADO					
FOF FRG FIC FIM		2.833.427	307.087.536	1,94%	
EXTERIOR					
BSHY39		5.845.867	331.519.118	2,09%	
CARTEIRA PRÓPRIA			547.492.438,88	3,46%	
RENTA VARIÁVEL			200,00	0,00%	
Mercado à Vista		20.000	200,00	0,00%	
Proman - Produtores Energéticos de Manso	ON	20.000	200,00	0,00%	
ESTRUTURADO			79.946.157,03	0,51%	
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia		41.163	36.305.250	0,23%	
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia		14.818	8.983.437	0,06%	
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia		25.550.479	25.550.479	0,16%	
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1		771.607	771.607	0,00%	
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP		43.534	8.335.384	0,05%	
IMOBILIARIO			1	395.591.488,29	2,50%
Certificados de Recebíveis Imobiliários		1	80.583.229,84	0,51%	
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital		1	80.583.229,84	0,51%	
Edificações de Uso Próprio			23.400.000,00	0,15%	
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ			23.400.000,00	0,15%	
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			293.200.000,00	1,85%	
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ			92.529.317,00	0,58%	
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ			68.970.683,00	0,44%	
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ			131.700.000,00	0,83%	
Valores a Receber			(0,00)	0,00%	
Valores a Pagar			(1.591.741,55)	-0,01%	
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			72.003.390,08	0,45%	
Saldo de Empréstimos			71.666.081,83	0,45%	
Valores a Receber			341.687,38	0,00%	
Valores a Pagar			4.379,13	0,00%	

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(48.796,52)	0,00%