

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
4º TRIMESTRE DE 2018

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2018		2017		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	11.689.223.682,97	81,46%	10.947.960.116,41	79,87%	Até 100%
Renda Variável	1.600.728.638,48	11,16%	1.668.335.688,22	12,17%	Até 25%
Investimentos Estruturados	219.609.861,92	1,53%	257.262.176,48	1,88%	Até 16%
Investimentos no Exterior	-	0,00%	-	0,00%	Até 4%
Investimentos Imobiliários	531.440.512,75	3,70%	528.246.046,58	3,85%	Até 8%
Operações com Participantes	290.879.587,49	2,03%	276.261.400,70	2,02%	Até 4%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	17.993.287,33	0,13%	29.868.349,14	0,22%	-
Total de Investimentos	14.349.875.570,94	100,00%	13.707.933.777,53	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	12,69%	IMA	10,03%
Títulos a Mercado	12,77%	IMA	10,03%
Títulos na Curva	12,44%	INPC + 5,70%	9,33%
Renda Variável	17,13%	-	-
Carteira de Mercado	13,49%	IBrX	15,42%
Carteira de Ativos Diversos	214,57%	IBrX	15,42%
FRG FIA - WESTERN	14,88%	IBrX	15,42%
FRG FIA - GAP	29,79%	IBrX	15,42%
FRG FIA - FT	16,92%	IBrX	15,42%
Investimentos Estruturados	2,44%	IMA-B + 2%	15,32%
Investimentos Imobiliários	11,59%	IFIX	5,62%
Operações com Participantes	10,15%	INPC + 5,70% ^(*)	9,93%
Total	12,47%	INPC + 5,70%	9,33%

(*) 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				
Fundos Exclusivos				
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	12.806.957.357,73	89,25%	-
		12.806.957.357,73	89,25%	-
		12.806.957.357,73	89,25%	-
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS				
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP	BRZ Investimentos	25.194.614,10	0,18%	3,76%
DGF FIPAC 2 FIP	DGF Investimentos	13.763.836,75	0,10%	2,05%
ÓRIA TECH 1 FIP	Ória Gestão de Recursos	37.819.642,16	0,26%	5,64%
FII Rio Bravo Renda Varejo	Rio Bravo	39.599.670,00	0,28%	5,91%
FIP Brasil Energia	BTG Pactual	55.107.759,67	0,38%	8,22%
FIP Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	8.238.607,04	0,06%	1,23%
Pátria Real Estate III FIP	Pátria Investimentos	39.885.732,20	0,28%	5,95%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA				
FRG FIA WESTERN ASSET	Western Asset	92.833.409,05	0,65%	13,85%
FRG FIA GAP	GAP Prudential LT	208.243.985,54	1,45%	31,06%
FRG FIA FT	Franklin Templeton Investimentos	149.681.791,58	1,04%	22,33%
Total		13.477.326.405,82	93,92%	-

(**) 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			14.349.875.570,94	100,00%
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADC			12.806.957.357,73	89,25%
RENDAS FIXAS			11.639.002.382,67	81,11%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			11.298.968.436,57	78,74%
Notas do Tesouro Nacional			8.891.982.302,75	61,97%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			5.352.222.440,10	37,30%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)		310.730	1.076.909.814	7,50%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		570.967	2.034.655.916	14,18%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)		191.258	698.128.692	4,87%
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)		23.204	96.338.857	0,67%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		199.718	1.339.893.150	9,34%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)		59.638	65.114.737	0,45%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2027)		37.644	41.181.273	0,29%
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			3.539.759.862,65	24,67%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)		9.223	28.534.018	0,20%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		326.916	885.781.208	6,17%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)		241.997	686.643.984	4,79%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)		3.399	10.379.388	0,07%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)		242.593	697.671.068	4,86%
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)		71.854	276.806.978	1,93%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		150.159	863.670.607	6,02%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)		99.165	90.272.611	0,63%
Títulos da Dívida Agrária		396	39.802,43	0,00%
Operações Compromissadas (Adelic)		2.240.073	2.406.946.331,39	16,77%
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			340.033.946,10	2,37%
Letras Financeiras			330.829.051,38	2,31%
Bradesco (Vencimento: 08/09/2023)		13	28.392.258,25	0,20%
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)		30	56.123.080,85	0,39%
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)		25	39.356.458,78	0,27%
Bradesco (Vencimento: 04/09/2028)		100	137.447.219,34	0,96%
Bradesco (Vencimento: 09/10/2028)		60	69.510.034,16	0,48%
Debêntures Não Conversíveis			9.204.894,72	0,06%
Vale (Vencimento: 08/07/2050)		655.840	9.204.894,72	0,06%
RENDAS VARIÁVEIS			1.149.969.252,31	8,01%
Mercado à Vista			1.142.435.162,15	7,96%
B3	ON	1.995.743	53.505.870	0,37%
Banco do Brasil	ON	1.279.228	59.471.310	0,41%
Bradesco	PN	3.058.160	118.197.884	0,82%
Brasil Seguridade	ON	1.967.794	54.291.436	0,38%
Brf Foods	ON	982.512	21.546.488	0,15%
Cemig S.A.	PN	4.461.484	61.836.168	0,43%
Grupo Pão de Açúcar	PN	362.714	29.372.580	0,20%
Itau Unibanco	PN	4.700.391	166.863.881	1,16%
Itausa	PN	6.737.771	81.392.274	0,57%
Klabin	UNT	1.480.334	23.507.704	0,16%
Localiza	ON	2.107.452	62.696.697	0,44%
Lojas Renner	ON	1.554.602	65.915.125	0,46%
Petrobras	ON	2.572.345	65.337.563	0,46%
Petrobras	PN	3.194.800	72.458.064	0,50%
Porto Seguro S.A.	ON	398.739	20.794.239	0,14%
Raiadrogasil	ON	151.996	8.686.571	0,06%
Suzano Papel e Celulose SA	ON	708.178	26.967.418	0,19%
Tim Participações S.A.	ON	2.368.649	28.068.491	0,20%
Vale do Rio Doce	ON	1.997.199	101.857.149	0,71%
Weg S.A.	ON	1.121.337	19.668.251	0,14%
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			7.534.090,16	0,05%
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis		4.620	2.589.741,00	0,02%
Proman - Produtores Energéticos de Mans		2.000	4.944.349,16	0,03%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBEF			17.985.722,75	0,13%
CARTEIRA PRÓPRIA			1.542.918.213,21	10,75%
RENDAS FIXAS			50.221.300,30	0,35%

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
Certificados de Recebíveis Imobiliários CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital		1	50.221.300,30 50.221.300,30	0,35% 0,35%
RENDA VARIÁVEL			200,00	0,00%
Mercado à Vista Proman - Produtores Energéticos de Manso	ON	20.000	200,00 200,00	0,00% 0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA			450.759.186,17	3,14%
FRG FIA WESTERN ASSSET		49.050.902	92.833.409,05	0,65%
FRG FIA GAP		94.530.803	208.243.985,54	1,45%
FRG FIA FT		887.559	149.681.791,58	1,04%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			219.609.861,92	1,53%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP		40.394	25.194.614	0,18%
DGF FIPAC 2 FIP		14.134	13.763.837	0,10%
ÓRIA TECH 1 FIP		23.285.289	37.819.642	0,26%
FII Rio Bravo Renda Varejo		33.000	39.599.670	0,28%
FIP Brasil Energia		2.888	55.107.760	0,38%
FIP Brasil Petróleo 1		44.684	8.238.607	0,06%
Pátria Real Estate III FIP		34.812	39.885.732	0,28%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			531.440.512,75	3,70%
Edificações de Uso Próprio Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ			42.320.000,00 42.320.000,00	0,29% 0,29%
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			481.178.000,00	3,35%
Rodovia Presidente Dutra, 238 - Rio de Janeiro - RJ			9.700.000,00	0,07%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ			153.608.000,00	1,07%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ			105.313.000,00	0,73%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ			212.557.000,00	1,48%
Edificações para Renda Ed Parque das Palmeiras, R. Omar T. Castro, L88/90 Q5 - Angra dos Reis - RJ			3.510.000,00 3.510.000,00	0,02% 0,02%
Valores a Receber			4.495.037,52	0,03%
Valores a Pagar			(62.524,77)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			290.879.587,49	2,03%
Saldo de Empréstimos			300.335.565,43	2,09%
Valores a Pagar/Receber			(9.455.977,94)	-0,07%
OUTROS REALIZÁVEIS			-	0,00%
Valores a Receber			-	0,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			7.564,58	0,00%