

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
1º TRIMESTRE DE 2019

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2019		2018		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	11.940.321.943,23	81,05%	11.552.068.711,97	81,22%	Até 100%
Renda Variável	1.703.116.814,96	11,56%	1.604.380.221,56	11,28%	Até 25%
Estruturado	178.399.115,12	1,21%	258.404.875,23	1,82%	Até 12%
Exterior	-	0,00%	-	0,00%	Até 4%
Imobiliário	623.749.291,60	4,23%	524.098.663,93	3,68%	Até 6%
Operações com Participantes	279.492.281,28	1,90%	273.420.882,49	1,92%	Até 4%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	6.412.298,17	0,04%	10.327.257,59	0,07%	-
Total de Investimentos	14.731.491.744,36	100,00%	14.222.700.612,77	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	4,37%	IMA	2,98%
Títulos a Mercado	4,91%	IMA	2,98%
Títulos na Curva	3,09%	INPC + 5,60%	3,07%
Renda Variável	7,07%	-	-
Carteira de Ações em Mercado (Própria)	6,66%	IBrX	8,64%
FRG FIA Western Asset	8,54%	IBrX	8,64%
FRG FIA Sharp	9,51%	IBrX	8,64%
FRG FIA FT	7,23%	IBrX	8,64%
Estruturado	-0,25%	IMA-B + 2%	6,07%
Imobiliário	1,49%	IFIX	5,59%
Operações com Participantes	2,12%	INPC + 5,60% (*)	1,64%
Total	4,45%	INPC + 5,60%	3,07%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 5,60% 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		13.160.555.246,11	89,34%	-
Fundos Exclusivos		13.160.555.246,11	89,34%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	13.160.555.246,11	89,34%	-
ESTRUTURADO		178.399.115,12	1,21%	25,23%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia	BRZ Investimentos	25.084.793,44	0,17%	3,55%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia	DGF Investimentos	10.944.156,06	0,07%	1,55%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia	Ória Gestão de Recursos	38.445.303,89	0,26%	5,44%
FIP Brasil Energia Multiestratégia	BTG Pactual	54.909.714,71	0,37%	7,77%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	7.082.107,75	0,05%	1,00%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP	Pátria Investimentos	41.933.039,27	0,28%	5,93%
IMOBILIÁRIO		39.369.000,00	0,27%	5,57%
FII Rio Bravo Renda Varejo	Rio Bravo Investimentos	39.369.000,00	0,27%	5,57%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA		489.321.277,67	3,32%	69,20%
FRG FIA Western Asset	Western Asset Management	100.764.012,89	0,68%	14,25%
FRG FIA Sharp	Sharp Capital	228.052.678,97	1,55%	32,25%
FRG FIA FT	Franklin Templeton	160.504.585,81	1,09%	22,70%
Total		13.867.644.638,90	94,14%	-

(**) 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			14.731.491.744,37	100,00%		
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADC			13.160.555.246,11	89,34%		
RENTA FIXA			11.940.321.943,23	81,05%		
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			11.574.130.932,55	78,57%		
Notas do Tesouro Nacional			9.222.734.117,22	62,61%		
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			5.614.398.395,75	38,11%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			310.730	1.088.227.304	7,39%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			570.967	2.191.137.147	14,87%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			191.258	757.326.286	5,14%	
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			23.204	99.579.310	0,68%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			199.718	1.372.706.537	9,32%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			59.638	64.655.322	0,44%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2027)			37.644	40.766.491	0,28%	
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			3.608.335.721,47	24,49%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			9.223	28.454.047	0,19%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			326.916	911.976.171	6,19%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			241.997	705.789.075	4,79%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			3.399	10.333.599	0,07%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			242.593	716.809.168	4,87%	
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			71.854	286.938.328	1,95%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			150.159	859.917.178	5,84%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			99.165	88.118.155	0,60%	
Títulos da Dívida Agrária			396	40.472,17	0,00%	
Operações Compromissadas (Adelic)			2.803.441	2.351.356.343,16	15,96%	
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			366.191.010,68	2,49%		
Letras Financeiras			347.230.105,57	2,36%		
Bradesco (Vencimento: 08/09/2023)			13	29.439.533,43	0,20%	
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)			30	58.353.842,01	0,40%	
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)			25	41.334.204,75	0,28%	
Bradesco (Vencimento: 04/09/2028)			100	144.816.568,67	0,98%	
Bradesco (Vencimento: 09/10/2028)			60	73.285.956,71	0,50%	
Debêntures Não Conversíveis			11.457.082,66	0,08%		
Vale (Vencimento: 08/07/2050)			655.840	11.457.082,66	0,08%	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			7.503.822,45	0,05%		
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis			4.620	2.589.741,00	0,02%	
Proman - Produtores Energéticos de Manso			2.000	4.914.081,45	0,03%	
RENTA VARIÁVEL			1.213.795.337,29	8,24%		
Mercado à Vista			1.213.795.337,29	8,24%		
Azul			PN	577.997	22.119.945,19	0,15%
B3			ON	1.643.446	52.787.485,52	0,36%
Banco do Brasil			ON	1.416.257	69.000.041,04	0,47%
Bradesco			PN	4.187.468	179.809.875,92	1,22%
Brasil Seguridade			ON	766.957	20.339.699,64	0,14%
BR Distribuidora			ON	439.778	10.180.860,70	0,07%
BR Foods			ON	282.767	6.404.672,55	0,04%
B2W			ON	635.808	26.843.813,76	0,18%
CCR			ON	1.918.109	22.518.599,66	0,15%
Cielo			ON	826.432	7.842.839,68	0,05%
Cemig			ON	461.171	7.701.555,70	0,05%
Cemig			PN	1.625.890	22.599.871,00	0,15%
CRFB			ON	421.092	8.459.738,28	0,06%
CSN			ON	310.929	5.052.596,25	0,03%
Energisa			UNT	744.233	30.178.648,15	0,20%
Equatorial			ON	226.352	18.108.160,00	0,12%
Estacio Participações			ON	573.101	15.244.486,60	0,10%
Gerdau			PN	337.595	5.111.188,30	0,03%
Hapvida			ON	377.391	11.608.547,16	0,08%
Hering			ON	191.004	5.709.109,56	0,04%
Hypera			ON	272.374	7.054.486,60	0,05%
Iguatemi			ON	102.169	3.976.417,48	0,03%
IRB Brasil			ON	292.553	26.695.461,25	0,18%
Itausa			PN	5.122.068	61.362.374,64	0,42%
Itau Unibanco			PN	2.492.612	85.820.631,16	0,58%
Klabin			UNT	426.040	7.255.461,20	0,05%
Kroton			ON	266.522	2.825.133,20	0,02%
Lojas Americanas			PN	473.939	7.947.957,03	0,05%

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
Linx	ON	246.025	9.102.925,00	0,06%
Lojas Renner	ON	1.166.738	51.103.124,40	0,35%
lochp-Maxion	ON	642.728	13.786.515,60	0,09%
Pão de Açúcar	PN	209.804	19.188.673,84	0,13%
Petrobras	ON	1.606.342	50.037.553,30	0,34%
Petrobras	PN	5.413.017	151.889.257,02	1,03%
Porto Seguro	ON	114.757	6.177.369,31	0,04%
Raiadrogasil	ON	95.493	6.235.692,90	0,04%
Rumo	ON	1.699.577	32.546.899,55	0,22%
Localiza	ON	1.520.695	50.274.176,70	0,34%
Sanepar	UNT	22.210	1.664.639,50	0,01%
Smiles	ON	96.659	4.610.634,30	0,03%
Suzano	ON	807.633	37.595.316,15	0,26%
Tim Participações	ON	1.238.710	14.604.390,90	0,10%
Totvs	ON	87.416	3.444.190,40	0,02%
Transmissão Paulista	PN	27.452	2.117.647,28	0,01%
Usiminas	PN	217.661	2.185.316,44	0,01%
Via Varejo	ON	204.334	862.289,48	0,01%
Weg	ON	322.726	5.809.068,00	0,04%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			6.437.965,58	0,04%
CARTEIRA PRÓPRIA			1.570.936.498,26	10,66%
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			489.321.277,67	3,32%
FRG FIA Western Asset		49.050.902	100.764.012,89	0,68%
FRG FIA Sharp		94.530.803	228.052.678,97	1,55%
FRG FIA FT		887.559	160.504.585,81	1,09%
ESTRUTURADO			178.399.115,12	1,21%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia		40.394	25.084.793	0,17%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia		14.203	10.944.156	0,07%
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia		23.285.289	38.445.304	0,26%
FIP Brasil Energia Multiestratégia		2.888	54.909.715	0,37%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1		44.684	7.082.108	0,05%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP		36.320	41.933.039	0,28%
IMOBILIÁRIO			623.749.291,60	4,23%
Certificados de Recebíveis Imobiliários			51.145.998,09	0,35%
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital		1	51.145.998,09	0,35%
FII Rio Bravo Renda Varejo (ex-Agências Caixa)		33.000	39.369.000	0,27%
Edificações de Uso Próprio			41.872.351,33	0,28%
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ			41.872.351,33	0,28%
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			476.795.898,49	3,24%
Rodovia Presidente Dutra, 238 - Rio de Janeiro - RJ			9.636.884,50	0,07%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ			152.284.111,49	1,03%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ			104.330.926,38	0,71%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ			210.543.976,12	1,43%
Edificações para Renda			3.168.140,19	0,02%
Ed Parque das Palmeiras, R. Omar T. Castro, L88/90 Q5 - Angra dos Reis - RJ			3.168.140,19	0,02%
Valores a Receber			11.907.591,35	0,08%
Valores a Pagar			(509.687,85)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			279.492.281,28	1,90%
Saldo de Empréstimos			290.106.256,88	1,97%
Valores a Pagar/Receber			(10.613.975,60)	-0,07%
OUTROS REALIZÁVEIS			-	0,00%
Valores a Receber			-	0,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(25.667,41)	0,00%