

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
RESUMO DO DEMONSTRATIVO ANALÍTICO DE INVESTIMENTOS E DE ENQUADRAMENTO DAS APLICAÇÕES
4º TRIMESTRE DE 2011

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	Dezembro/2011		Dezembro/2010		Limites da Política de Investimentos
	R\$	%	R\$	%	
Renda Fixa	6.890.461.845,42	74,75%	6.207.715.212,07	75,65%	Até 100%
Renda Variável	1.559.859.901,77	16,92%	1.428.638.606,18	17,41%	Até 27%
Investimentos Estruturados	108.105.181,77	1,17%	-	0,00%	Até 9%
Investimentos Imobiliários	375.106.939,77	4,07%	200.445.933,43	2,44%	Até 8%
Empréstimos e Financiamentos	265.882.554,40	2,88%	257.073.128,42	3,13%	Até 7%
Caixa/Despesas a Pagar	18.377.554,64	0,20%	111.742.444,16	1,36%	-
Depósitos	-	0,00%	-	0,00%	-
Total de Investimentos	9.217.793.977,77	100,00%	8.205.615.324,26	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Valor da Cota	Rentabilidade no Trimestre	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	1,42789	2,85%	12,37%	-	-
Títulos a Mercado	1,45549	2,83%	12,06%	IMA	13,61%
Títulos na Curva	1,57372	2,94%	13,34%	INPC + 6%	12,44%
Renda Variável	1,25380	8,56%	-6,87%	-	-
Carteira de Mercado	1,25838	8,57%	-7,53%	IBrX	-11,39%
Carteira de Ativos Diversos	1,36272	8,11%	17,29%	IBrX	-11,39%
Investimentos Estruturados	1,39147	37,24%	39,72%	IMA-B + 2%	17,40%
Investimentos Imobiliários	5,63611	100,18%	123,90%	IMA	13,61%
Empréstimos e Financiamentos	1,61385	3,07%	13,22%	INPC + 6%*	13,06%
Total	1,62803	6,26%	11,88%	INPC + 6%	12,44%

* De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 6% a.a. como benchmark do Segmento de Empréstimos e Financiamentos foi apurada com defasagem de 2 (dois) meses para o INPC.

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Saldo (R\$)	Participação no total
RENDA FIXA	8.451.884.013,45	91,69%
Fundos Exclusivos	8.425.983.147,37	91,41%
FRG Plano BD FI Multimercado	8.425.983.147,37	91,41%
Fundos Invest. Direitos Creditórios	25.900.866,08	0,28%
CHEMICAL VI FIDC	25.900.866,08	0,28%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	108.105.181,77	1,17%
FIP Brasil Energia	108.105.181,77	1,17%
TOTAL	8.559.989.195,22	92,86%

TOTAL DE RECURSOS ADMINISTRADOS PELA REAL GRANDEZA

Segmento	Plano BD	Plano CD	Fundos Assistenciais	Programa Administrativo	Total
Renda Fixa	6.890.461.845,42	200.710.137,07	118.343.770,56	52.309.390,30	7.261.825.143,35
Renda Variável	1.559.859.901,77	62.186.632,87	-	-	1.622.046.534,64
Investimentos Estruturados	108.105.181,77	-	-	-	108.105.181,77
Investimentos Imobiliários	375.106.939,77	-	-	-	375.106.939,77
Empréstimos e Financiamentos	265.882.554,40	31.188.380,41	292.498,15	-	297.363.432,96
Caixa/Despesas a Pagar	18.377.554,64	1.502.014,61	991,80	-1.947,15	19.878.613,90
Depósitos	-	-	-	-	-
Total	9.217.793.977,77	295.587.164,96	118.637.260,51	52.307.443,15	9.684.325.846,39

RENTABILIDADES DOS PLANOS ADMINISTRADOS PELA REAL GRANDEZA

Período	Plano BD	Plano CD	Fundos Assistenciais	Programa Administrativo	Total
Ano de 2011	11,88%	9,01%	12,18%	11,52%	11,81%

Responsáveis

KPMG Auditores Independentes
Auditor de Gestão

Eduardo Henrique Garcia
Administrador Responsável

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	Valor de Mercado (R\$)	% Aplic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			9.109.688.827,74	100,00
BRADESCO FI MULTIMERCADO			8.425.983.147,37	92,49
RENDA FIXA			6.862.416.200,20	75,33
Certificados de Depósito Bancário			58.216.868,51	0,64
BNP S.A.		55.000	58.216.868,51	0,64
LF			136.094.083,00	
Itaú		25	27.632.361,58	0,30
Bradesco		25	27.695.323,30	0,30
Bradesco		10	27.490.169,00	0,30
Safra		10	26.670.768,09	0,29
Itaú		25	26.605.461,03	0,29
Notas do Tesouro Nacional		2.362.471	5.905.444.661,62	64,83
ADELIC		255.115	556.043.063,16	6,10
TDA		61.131	5.514.447,75	0,06
Quotas de FIDC			25.900.866,08	0,28
CHEMICALVI FIDC		25.830	25.900.866,08	0,28
Debêntures não Conversíveis			175.202.210,08	1,92
CIA. VALE DO RIO DOCE S.A.		655.840	4.275.848,93	0,05
TRIUNFO Participações e Investimentos S.A.		12.000	10.611.818,72	0,12
TELEMAR PARTICIPAÇÕES S.A.		1.740	7.153.757,61	0,08
DUKE ENERGY INTERNACIONAL – Geração Paranapanema S.A.		1.500	7.880.892,13	0,09
Natura Cosméticos S.A.		14	14.177.460,57	0,16
BNDES PARTICIPAÇÕES S.A.		70.256	82.169.176,98	0,90
BNDES PARTICIPAÇÕES S.A.		42.238	48.933.255,14	0,54
RENDA VARIÁVEL			1.557.176.237,89	17,09
Mercado à Vista			1.552.378.462,53	17,04
AES ELPA S.A.	ON	333.918	15.193.269,00	0,17
AESC - AES COMMUNIC RJ	ON	333.918	0,00	0,00
AMBEV	PN	1.451.400	97.679.220,00	1,07
BANCO DO BRASIL	ON	2.589.900	61.380.630,00	0,67
BANCO BRADESCO S.A.	PN	3.576.242	109.969.441,50	1,21
BFR - BRASIL FOODS S.A.	ON	1.939.914	70.651.667,88	0,78
BR MALLS PAR	ON	1.064.400,00	19.286.928,00	0,21
CCR - COMPANHIA DE CONCESSÕES RODOVIÁRIAS	ON	3.183.200	38.898.704,00	0,43
CIELO	ON	854.200	41.172.440,00	0,45
CIA. ENERGÉTICA DE MINAS GERAIS - CEMIG	PN	1.577.295	52.476.604,65	0,58
CIA. SIDERÚRGICA NACIONAL - CSN	ON	2.903.100	43.488.438,00	0,48
DIAGNÓSTICOS DA AMÉRICA S.A. - DASA	ON	1.801.500	27.923.250,00	0,31
GERDAU S.A.	PN	3.559.600	51.614.200,00	0,57
ITAUSA	PN	6.952.156	78.420.319,68	0,86
ITAU UNIBANCO	PN	3.946.000	134.124.540,00	1,47
LOJAS RENNERTON NM	ON	601.300	29.108.933,00	0,32
PDG REALTON NM	ON	2.531.000	14.932.900,00	0,16
PETRÓLEO BRASILEIRO S.A. - PETROBRÁS	ON	5.687.607	130.814.961,00	1,44
PETRÓLEO BRASILEIRO S.A. - PETROBRÁS	PN	8.390.068	180.302.561,32	1,98
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	ON	1.278.900	32.739.840,00	0,36
ULTRAPAR PARTICIPAÇÕES S.A.	ON	1.254.900	40.169.349,00	0,44
VALE R DOCE	ON	1.962.200	77.408.790,00	0,85
VALE R DOCE	PNA	4.003.800	151.423.716,00	1,66
VIVT - TELEF BRASIL	PN	1.025.005	53.197.759,50	0,58

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

Discriminação	Espécie	Quantidade	Valor de Mercado (R\$)	% Aplic.
Deb. Conv. Emissão Pública c/ Partic. Lucros			4.797.775,36	0,05
CRT - CONCESSIONÁRIA RIO TERESÓPOLIS S.A.		4.620	2.653.109,17	0,03
PROMAN - PRODUTORES ENERGÉTICOS DE MANSO S.A.		2.000	2.144.666,19	0,02
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			6.390.709,28	0,07
CARTEIRA PRÓPRIA			42.716.186,20	0,47
RENTA FIXA			28.045.645,22	0,31
CRI			28.045.645,22	0,31
CRI		1	28.045.645,22	0,31
RENTA VARIÁVEL			2.683.663,88	0,03
Mercado à Vista			2.683.663,88	0,03
PROMAN - PRODUTORES ENERGÉTICOS DE MANSO S.A.	ON	20.000	200,00	0,00
GTD PARTICIPAÇÕES S.A.	ON	5.147.644	1.389.863,88	0,02
GTD PARTICIPAÇÕES S.A.	PN	4.620.000	1.293.600,00	0,01
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			108.105.181,77	1,19
FIP BRASIL ENERGIA		2.888	108.105.181,77	1,19
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			11.986.877,10	0,13
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			375.106.939,77	4,12
Edificações de Uso Próprio			32.954.534,35	0,36
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro			32.954.534,35	0,36
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			311.175.174,18	3,42
Rodovia Presidente Dutra, 238 - RJ			5.640.003,60	0,06
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro			110.329.493,25	1,21
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro			63.017.204,05	0,69
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro			132.188.473,28	1,45
Edificações para Renda			27.950.261,10	0,31
Av. Imperatriz Leopoldina, 845 - São Paulo			23.345.675,98	0,26
Ed P. Palmeiras, R. Omar T. Castro, L88/90 Q5 - Angra dos Reis			4.604.585,12	0,05
Valores a Receber			3.061.970,14	0,03
Valores a Pagar			(35.000,00)	(0,00)
EMPRÉSTIMOS A PARTICIPANTES			265.882.554,40	2,92
Valores a Receber			262.940.888,45	2,89
Valores a Pagar			2.941.665,95	0,03