

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
1º TRIMESTRE DE 2024

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2024		2023		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	14.407.875.655,01	90,88%	14.540.613.690,80	91,15%	Até 100%
Renda Variável	370.679.732,63	2,34%	485.815.944,36	3,05%	Até 10%
Estruturado	389.403.047,66	2,46%	263.690.087,46	1,65%	Até 10%
Exterior	298.431.510,35	1,88%	-	0,00%	Até 10%
Imobiliário	438.833.868,23	2,77%	443.782.293,16	2,78%	Até 10%
Operações com Participantes	94.655.377,68	0,60%	105.629.974,76	0,66%	Até 2%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	(146.435.255,36)	-0,92%	112.725.716,30	0,71%	-
Total de Investimentos	15.853.443.936,20	100,00%	15.952.257.706,84	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	1,76%	IMA	1,64%
Títulos a Mercado	0,12%	IMA	1,64%
Títulos na Curva	2,87%	INPC + 4,98%	2,82%
Renda Variável	(3,74%)	IBOVESPA	(4,53%)
Exterior	1,17%	USD	3,20%
Estruturado	0,18%	IHFA	0,68%
Imobiliário	(0,08%)	IFIX	2,92%
Operações com Participantes	3,25%	INPC + 4,98% ^(*)	2,46%
Total	1,53%	INPC + 4,98%	2,82%

(*) 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			15.231.295.095,61	96,08%	-
Fundos Exclusivos			15.231.295.095,61	96,08%	-
FRG Plano BD FI Multimercado		Real Grandeza	15.231.295.095,61	96,08%	-
ESTRUTURADO			88.599.093,08	0,56%	70,34%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia		BRZ Investimentos	36.301.565,26	0,23%	28,82%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia		DGF Investimentos	9.444.797,82	0,06%	7,50%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia		Ória Gestão de Recursos	28.306.292,69	0,18%	22,47%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1		Mare e Mantiq	745.358,19	0,00%	0,59%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP		Pátria Investimentos	13.801.079,12	0,09%	10,96%
IMOBILIÁRIO			37.365.900,00	0,24%	29,66%
FII Rio Bravo Renda Varejo		Rio Bravo Investimentos	37.365.900,00	0,24%	29,66%
Total			15.357.260.088,69	96,87%	-

(**) 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			15.853.443.936,20	100,00%
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADO			15.231.295.095,61	96,08%
RENTA FIXA			14.407.875.655,01	90,88%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			11.942.533.061,04	75,33%
Notas do Tesouro Nacional			11.387.088.027,21	71,83%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			2.597.929.664,75	16,39%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)		220.730	938.752.650	5,92%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		199.718	1.659.177.015	10,47%
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			8.789.158.362,46	55,44%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)		9.223	39.343.394	0,25%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2028)		103.751	450.839.825	2,84%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2030)		46.832	208.396.204	1,31%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2032)		10.650	44.540.372	0,28%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2033)		39.236	174.484.010	1,10%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		524.146	2.115.776.192	13,35%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2040)		318.991	1.401.084.430	8,84%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)		330.497	1.330.819.315	8,39%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)		139.999	598.569.993	3,78%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)		242.593	959.822.748	6,05%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2060)		40.600	171.018.892	1,08%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		150.159	1.195.468.739	7,54%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)		99.165	98.994.249	0,62%
Operações Compromissadas (Adelic)		38.354	555.445.034	3,50%
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			481.165.574,74	3,04%
Letras Financeiras			474.975.754,40	3,00%
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)		30	89.971.606	0,57%
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)		25	62.943.270	0,40%
Bradesco (Vencimento: 04/09/2028)		100	213.975.444	1,35%
Bradesco (Vencimento: 09/10/2028)		60	108.085.435	0,68%
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			6.189.820,34	0,04%
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis		4.620	2.589.741	0,02%
Proman - Produtores Energéticos de Manso		2.000	3.600.079	0,02%
FRG Consolidador Refix FIM		1.917.083.691	1.984.177.019,23	12,52%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(146.495.756,96)	-0,92%
RENTA VARIÁVEL			370.679.732,63	2,34%
Mercado à Vista			200,00	0,00%
Proman - Produtores Energéticos de Manso	ON	20.000	200,00	0,00%
FRG Consolidador RV FIM		3.298.739	370.679.532,63	2,34%
ESTRUTURADO				
FOF FRG FIC FIM		2.833.427	300.803.955	1,90%
EXTERIOR				
BSHY39		5.845.867	298.431.510	1,88%
CARTEIRA PRÓPRIA			622.148.840,59	3,92%
ESTRUTURADO			88.599.093,08	0,56%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia		41.163	36.301.565	0,23%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia		14.783	9.444.798	0,06%
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia		23.508.539	28.306.293	0,18%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1		45.253	745.358	0,00%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP		43.534	13.801.079	0,09%
IMOBILIÁRIO			438.833.868,23	2,77%
Certificados de Recebíveis Imobiliários			77.193.045,58	0,49%
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital		1	77.193.045,58	0,49%
FII Rio Bravo Renda Varejo (ex-Agências Caixa)		330.000	37.365.900	0,24%

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
Edificações de Uso Próprio			25.000.000,00	0,16%
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ			25.000.000,00	0,16%
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			299.400.000,00	1,89%
Rodovia Presidente Dutra, 238 - Rio de Janeiro - RJ			-	0,00%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ			94.133.540,00	0,59%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ			70.166.460,00	0,44%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ			135.100.000,00	0,85%
Valores a Receber			(0,00)	0,00%
Valores a Pagar			(125.077,35)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			94.655.377,68	0,60%
Saldo de Empréstimos			94.203.389,88	0,59%
Valores a Receber			470.635,50	0,00%
Valores a Pagar			(18.647,70)	0,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			60.501,60	0,00%