

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
2º TRIMESTRE DE 2023

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2023		2022		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	13.365.251.806,36	84,28%	12.288.027.108,86	78,00%	Até 100%
Renda Variável	1.506.775.908,50	9,50%	2.598.494.405,62	16,49%	Até 25%
Estruturado	257.422.352,87	1,62%	95.744.827,41	0,61%	Até 10%
Exterior	-	0,00%	-	0,00%	Até 10%
Imobiliário	496.648.916,18	3,13%	515.944.480,68	3,28%	Até 10%
Operações com Participantes	130.367.720,66	0,82%	151.554.995,97	0,96%	Até 5%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	101.803.981,86	0,64%	103.900.988,59	0,66%	-
Total de Investimentos	15.858.270.686,43	100,00%	15.753.666.807,13	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	5,40%	IMA	8,64%
Títulos a Mercado	5,84%	IMA	8,64%
Títulos na Curva	5,19%	INPC + 4,86%	5,15%
Renda Variável	6,28%	IBOVESPA	7,61%
Carteira de Ações em Mercado (Própria)	0,00%	IBOVESPA	7,61%
FRG FIA Sharp	7,17%	IBOVESPA	7,61%
FRG FIA Claritas	5,97%	IBOVESPA	7,61%
Estruturado	(5,85%)	IHFA	4,01%
Imobiliário	(4,24%)	IFIX	10,05%
Operações com Participantes	6,96%	INPC + 4,86% (*)	5,99%
Total	4,64%	INPC + 4,86%	5,15%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 4,86% 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		13.365.586.501,33	84,28%	-
Fundos Exclusivos		13.365.586.501,33	84,28%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	13.365.586.501,33	84,28%	-
ESTRUTURADO		257.422.352,87	1,62%	14,31%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia	BRZ Investimentos	37.950.884,94	0,24%	2,11%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia	DGF Investimentos	9.450.808,01	0,06%	0,53%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia	Ória Gestão de Recursos	23.752.283,73	0,15%	1,32%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	2.680.810,13	0,02%	0,15%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP	Pátria Investimentos	15.351.512,75	0,10%	0,85%
FOF FRG FIC FIM	Real Grandeza	168.236.053,31	1,06%	9,35%
IMOBILIÁRIO		35.174.700,00	0,22%	1,95%
FII Rio Bravo Renda Varejo	Rio Bravo Investimentos	35.174.700,00	0,22%	1,95%
FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA		683.676.569,61	4,31%	38,00%
FRG FIA Sharp	Sharp Capital	493.395.579,40	3,11%	27,42%
FRG FIA Claritas	Claritas Adm. de Recursos	190.280.990,21	1,20%	10,57%
FUNDOS DE ÍNDICE - ETF		823.099.138,89	5,19%	45,74%
Ishares BOVA11	Black Rock Brasil	823.099.138,89	5,19%	45,74%
It Now BOVV11	Banco Itaú S/A	-	0,00%	0,00%
Total		15.164.959.262,70	95,63%	-

(**) 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			15.858.270.686,43	100,00%
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADO			13.365.586.501,33	84,28%
RENDA FIXA			13.365.251.806,36	84,28%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			12.856.213.836,40	81,07%
Notas do Tesouro Nacional			12.570.713.561,07	79,27%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			4.639.900.199,74	29,26%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)		310.730	1.292.326.169	8,15%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2028)		15.523	67.677.797	0,43%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2030)		15.465	68.474.442	0,43%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2035)		158.370	702.351.866	4,43%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)		191.258	849.579.344	5,36%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		199.718	1.659.490.582	10,46%
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			7.930.813.361,33	50,01%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)		9.223	38.526.237	0,24%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2028)		103.751	444.990.595	2,81%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2030)		46.832	205.886.941	1,30%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2032)		10.650	43.824.024	0,28%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2033)		39.236	167.245.397	1,05%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		524.146	2.014.319.177	12,70%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2040)		268.991	1.163.698.914	7,34%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)		290.497	1.097.736.406	6,92%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)		99.999	418.145.141	2,64%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)		242.593	915.465.548	5,77%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2060)		20.600	81.482.517	0,51%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		150.159	1.240.069.103	7,82%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)		99.165	99.423.360	0,63%
Operações Compromissadas (Adelic)		21.429	285.500.275	1,80%
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			509.037.969,96	3,21%
Letras Financeiras			482.282.182,32	3,04%
Bradesco (Vencimento: 08/09/2023)		13	42.546.659	0,27%
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)		30	82.313.328	0,52%
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)		25	58.146.140	0,37%
Bradesco (Vencimento: 04/09/2028)		100	198.827.487	1,25%
Bradesco (Vencimento: 09/10/2028)		60	100.448.567	0,63%
Debêntures Não Conversíveis			20.547.737,88	0,13%
Vale (Vencimento: 08/07/2050)		655.840	20.547.738	0,13%
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			6.208.049,76	0,04%
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis		4.620	2.589.741	0,02%
Proman - Produtores Energéticos de Manso		2.000	3.618.309	0,02%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			334.694,97	0,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			2.492.684.185,10	15,72%
RENDA VARIÁVEL			1.506.775.908,50	9,50%
FUNDO DE ÍNDICE - ETF			823.099.138,89	5,19%
Ishares BOVA11		7.209.417	823.099.139	5,19%
It Now BOVV11		-	-	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			683.676.569,61	4,31%
FRG FIA Sharp		140.088.361	493.395.579,40	3,11%
FRG FIA Claritas		117.852.476	190.280.990,21	1,20%
ESTRUTURADO			257.422.352,87	1,62%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia		41.163	37.950.885	0,24%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia		14.748	9.450.808	0,06%
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia		23.508.539	23.752.284	0,15%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1		45.253	2.680.810	0,02%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP		43.534	15.351.513	0,10%
FOF FRG FIC FIM		1.660.035	168.236.053	1,06%
IMOBILIÁRIO			496.648.916,18	3,13%

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
Certificados de Recebíveis Imobiliários			72.319.319,40	0,46%
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital		1	72.319.319,40	0,46%
FII Rio Bravo Renda Varejo (ex-Agências Caixa)		330.000	35.174.700	0,22%
Edificações de Uso Próprio			34.000.000,00	0,21%
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ			34.000.000,00	0,21%
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			353.700.000,00	2,23%
Rodovia Presidente Dutra, 238 - Rio de Janeiro - RJ			9.900.000,00	0,06%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ			108.972.606,50	0,69%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ			81.227.393,50	0,51%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ			153.600.000,00	0,97%
Valores a Receber			1.773.703,44	0,01%
Valores a Pagar			(318.806,66)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			130.367.720,66	0,82%
Saldo de Empréstimos			129.986.423,22	0,82%
Valores a Receber			419.211,59	0,00%
Valores a Pagar			(37.914,15)	0,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			101.469.286,89	0,64%