

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
3º TRIMESTRE DE 2020

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2020		2019		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	11.536.661.605,83	75,03%	11.448.025.946,82	71,41%	Até 100%
Renda Variável	2.869.197.212,19	18,66%	3.504.331.411,25	21,86%	Até 30%
Estruturado	137.821.887,51	0,90%	188.230.695,91	1,17%	Até 12%
Exterior	-	0,00%	-	0,00%	Até 4%
Imobiliário	598.152.705,44	3,89%	630.593.728,33	3,93%	Até 6%
Operações com Participantes	220.826.462,51	1,44%	247.189.195,13	1,54%	Até 4%
Caixa/Despesas a Pagar/Receber	13.843.838,75	0,09%	13.197.555,91	0,08%	-
Total de Investimentos	15.376.503.712,23	100,00%	16.031.568.533,35	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	6,74%	IMA	2,41%
Títulos a Mercado	4,59%	IMA	2,41%
Títulos na Curva	11,16%	INPC + 5,00%	6,00%
Renda Variável	(17,52%)	-	-
Carteira de Ações em Mercado (Própria)	(17,95%)	IBrX	(17,42%)
FRG FIA Western Asset	(12,65%)	IBrX	(17,42%)
FRG FIA Sharp	(15,06%)	IBrX	(17,42%)
FRG FIA FT	(15,78%)	IBrX	(17,42%)
FRG FIA Claritas(**)	20,53%	IBrX(**)	30,62%
Estruturado	(10,45%)	IMA-B + 2%	0,77%
Imobiliário	(0,75%)	IFIX	(12,59%)
Operações com Participantes	7,70%	INPC + 5,00% ^(*)	6,66%
Total	1,10%	INPC + 5,00%	6,00%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 5,60% a.a. de jan até mar /2020 e INPC + 5,00% a.a. a partir de abr/2020, como benchmark do Segmento de Operações com Participantes foi apurada com defasagem de 2 (dois) meses para o INPC.

(**) O FRG FIA Claritas iniciou em 12/03/2020, portanto, a sua rentabilidade no ano de 2020 é referente desde o seu início, bem como o comparativo com o seu Benchmark (IBrX).

RECURSOS EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS

	Gestor	Saldo (R\$)	Participação no Total	Partic. Total Terceirizado ^(**)
MULTIMERCADO/RENDA FIXA		13.773.957.662,98	89,58%	-
Fundos Exclusivos		13.773.957.662,98	89,58%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	13.773.957.662,98	89,58%	-
ESTRUTURADO		137.821.887,51	0,90%	16,74%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia	BRZ Investimentos	19.905.994,30	0,13%	2,42%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia	DGF Investimentos	11.701.357,35	0,08%	1,42%
Ória Tech1 Inovação FIP Multiestratégia	Ória Gestão de Recursos	42.461.173,23	0,28%	5,16%
FIP Brasil Energia Multiestratégia	BTG Pactual	20.291.330,18	0,13%	2,47%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1	Mare e Mantig	5.212.809,21	0,03%	0,63%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP	Pátria Investimentos	38.249.223,24	0,25%	4,65%
IMOBILIÁRIO		39.567.000,00	0,26%	4,81%
FII Rio Bravo Renda Varejo	Rio Bravo Investimentos	39.567.000,00	0,26%	4,81%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA		645.787.661,33	4,20%	78,45%
FRG FIA Western Asset	Western Asset Management	62.290.169,06	0,41%	7,57%
FRG FIA Sharp	Sharp Capital	369.977.691,03	2,41%	44,95%
FRG FIA FT	Franklin Templeton	71.470.903,36	0,46%	8,68%
FRG FIA Claritas	Claritas Adm. de Recursos	142.048.897,88	0,92%	17,26%
Total		14.597.134.211,82	94,93%	-

(**) 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			15.376.503.712,23	100,00%		
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADO			13.773.957.662,98	89,58%		
RENDA FIXA			11.536.661.605,83	75,03%		
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			11.081.680.338,88	72,07%		
Notas do Tesouro Nacional			8.544.068.260,88	55,57%		
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			4.612.933.657,78	30,00%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			310.730	1.200.540.460	7,81%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			158.370	664.254.499	4,32%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			191.258	814.948.167	5,30%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			-	-	0,00%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			-	-	0,00%	
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			23.204	117.351.658	0,76%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			199.718	1.702.956.443	11,08%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			59.638	69.086.361	0,45%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2027)			37.644	43.796.069	0,28%	
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			3.931.134.603,10	25,57%		
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			9.223	29.984.812	0,20%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			326.916	959.626.891	6,24%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			241.997	738.209.756	4,80%	
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			3.399	10.789.533	0,07%	
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			242.593	748.598.371	4,87%	
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			71.854	347.842.106	2,26%	
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			150.159	1.005.249.780	6,54%	
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			99.165	90.833.354	0,59%	
Operações Compromissadas (Adelic)			4.140.029	2.537.612.078	16,50%	
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			454.981.266,95	2,96%		
Letras Financeiras			423.146.916,18	2,75%		
Bradesco (Vencimento: 08/09/2023)			13	36.672.155,65	0,24%	
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)			30	71.904.785,32	0,47%	
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)			25	50.544.725,97	0,33%	
Bradesco (Vencimento: 04/09/2028)			100	175.333.994,25	1,14%	
Bradesco (Vencimento: 09/10/2028)			60	88.691.254,99	0,58%	
Debêntures Não Conversíveis			24.788.369,77	0,16%		
Vale (Vencimento: 08/07/2050)			655.840	24.788.369,77	0,16%	
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			7.045.981,00	0,05%		
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis			4.620	2.589.741,00	0,02%	
Proman - Produtores Energéticos de Manso			2.000	4.456.240,00	0,03%	
RENDA VARIÁVEL			2.223.409.350,86	14,46%		
Mercado à Vista			2.223.409.350,86	14,46%		
Alpargatas			PN	1.376.787	52.593.263,40	0,34%
Aliansce Shopping Centers S.A.			ON	338.116	8.020.111,52	0,05%
B3			ON	4.130.822	227.236.518,22	1,48%
Brasil			ON	1.432.942	42.443.742,04	0,28%
Bradesco			PN	5.124.473	99.466.020,93	0,65%
Minerva			ON	2.255.582	26.480.532,68	0,17%
Petrobras BR			ON	981.114	19.769.447,10	0,13%
B2W Digital			ON	374.983	33.740.970,34	0,22%
CCR S.A.			ON	1.478.998	18.738.904,66	0,12%
CPFL Energia			ON	1.714.556	47.253.163,36	0,31%
Cyrela Realt			ON	1.213.992	28.213.174,08	0,18%
Duratex			ON	325.974	5.844.713,82	0,04%
Equatorial			ON	4.637.291	98.217.823,38	0,64%
Gerdau			PN	383.260	7.971.808,00	0,05%
Notre Dame Intermédica			ON	132.156	8.598.069,36	0,06%
Gerdau Metalúrgica			PN	1.515.331	14.244.111,40	0,09%
Hapvida			ON	561.235	34.875.142,90	0,23%
Hypera			ON	1.900.559	56.674.669,38	0,37%
Itausa			PN	6.815.349	59.975.071,20	0,39%
ItauUnibanco			PN	5.847.294	131.564.115,00	0,86%
Klabin S.A.			UNT	1.210.924	28.819.991,20	0,19%
Lojas Americanas			PN	440.515	12.506.220,85	0,08%
Locamerica			ON	794.867	18.878.091,25	0,12%
Lojas Renner			ON	1.925.529	76.347.224,85	0,50%
M.Diasbranco			ON	768.972	26.268.083,52	0,17%
Magaz Luiza			ON	684.974	61.099.680,80	0,40%

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
Multiplan	ON	1.052.062	20.441.564,66	0,13%
Grupo Natura	ON	1.940.961	99.241.335,93	0,65%
Petrobras	ON	984.480	19.463.169,60	0,13%
Petrobras	PN	6.347.752	124.479.416,72	0,81%
RaiaDrogasil	ON	850.640	19.921.988,80	0,13%
Rumo S.A.	ON	360.390	6.869.033,40	0,04%
Randon Part	PN	810.368	9.862.178,56	0,06%
Localiza	ON	1.708.425	96.816.444,75	0,63%
Sanepar	UNT	427.235	10.868.858,40	0,07%
Sul America	UNT	1.591.359	63.065.557,17	0,41%
Tim Part S.A.	ON	2.163.249	28.252.031,94	0,18%
Totvs	ON	589.269	15.969.189,90	0,10%
Ultrapar	ON	1.898.196	36.578.236,92	0,24%
Vale	ON	4.796.657	283.530.395,27	1,84%
Viavarejo	ON	2.158.748	37.454.277,80	0,24%
Weg	ON	847.838	55.702.956,60	0,36%
Yduqs Part	ON	567.451	15.553.831,91	0,10%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			13.886.706,29	0,09%
CARTEIRA PRÓPRIA			1.602.546.049,25	10,42%
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			645.787.661,33	4,20%
FRG FIA Western Asset		29.377.300	62.290.169,06	0,41%
FRG FIA Sharp		140.088.361	369.977.691,03	2,41%
FRG FIA FT		390.637	71.470.903,36	0,46%
FRG FIA Claritas		117.852.476	142.048.897,88	0,92%
ESTRUTURADO			137.821.887,51	0,90%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP Multiestratégia		41.163	19.905.994	0,13%
DGF Fipac 2 FIP Multiestratégia		14.437	11.701.357	0,08%
Ória Tech 1 Inovação FIP Multiestratégia		23.285.289	42.461.173	0,28%
FIP Brasil Energia Multiestratégia		2.888	20.291.330	0,13%
FIP Multiestratégia Brasil Petróleo 1		44.993	5.212.809	0,03%
Pátria Real Estate III Private I FIQ FIP		40.224	38.249.223	0,25%
IMOBILIÁRIO			598.152.705,44	3,89%
Certificados de Recebíveis Imobiliários			57.302.351,43	0,37%
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital		1	57.302.351,43	0,37%
FII Rio Bravo Renda Varejo (ex-Agências Caixa)		330.000	39.567.000	0,26%
Edificações de Uso Próprio			32.700.000,00	0,21%
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ			32.700.000,00	0,21%
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			450.503.289,29	2,93%
Rodovia Presidente Dutra, 238 - Rio de Janeiro - RJ			9.258.191,45	0,06%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ			144.340.780,44	0,94%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ			98.438.484,71	0,64%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ			198.465.832,69	1,29%
Edificações para Renda			1.626.387,41	0,01%
Ed Parque das Palmeiras, R. Omar T. Castro, L88/90 Q5 - Angra dos Reis - RJ			1.626.387,41	0,01%
Valores a Receber			16.811.581,98	0,11%
Valores a Pagar			(357.904,67)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			220.826.462,51	1,44%
Saldo de Empréstimos			243.572.842,15	1,58%
Valores a Pagar/Receber			(22.746.379,64)	-0,15%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			(42.867,54)	0,00%