

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
2º TRIMESTRE DE 2015

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2015		2014		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	8.492.000.517,11	71,38%	8.049.403.367,28	70,84%	Até 100%
Renda Variável	2.345.258.050,85	19,71%	2.262.655.385,93	19,91%	Até 30%
Investimentos Estruturados	212.741.336,20	1,79%	191.406.870,36	1,68%	Até 18%
Investimentos no Exterior	-	0,00%	-	0,00%	Até 2%
Investimentos Imobiliários	572.310.725,24	4,81%	581.154.903,62	5,11%	Até 6%
Operações com Participantes	268.167.414,12	2,25%	270.350.817,10	2,38%	Até 6%
Caixa/Despesas a Pagar	7.045.223,26	0,06%	7.214.400,43	0,06%	-
Total de Investimentos	11.897.523.266,78	100,00%	11.362.185.744,72	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	8,34%	-	-
Títulos a Mercado	8,16%	IMA	6,49%
Títulos na Curva	8,90%	INPC + 5,50%	9,70%
Renda Variável	5,33%	-	-
Carteira de Mercado	5,27%	IBrX	6,41%
Carteira de Ativos Diversos	35,17%	IBrX	6,41%
FRG FIA - Q	3,29%	IBrX	6,41%
FRG FIA - GAP	4,61%	IBrX	6,41%
Investimentos Estruturados	-0,86%	IMA-B + 2%	9,42%
Investimentos Imobiliários	2,69%	IMA	6,49%
Operações com Participantes	9,03%	INPC + 5,50% ^(*)	9,04%
Total	7,27%	INPC + 5,50%	9,70%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 5,50% 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		10.707.004.024,23	89,99%	-
Fundos Exclusivos		10.707.004.024,23	89,99%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	10.707.004.024,23	89,99%	-
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		212.741.336,20	1,79%	68,01%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP	BRZ Investimentos	15.210.428,00	0,13%	4,86%
DGF FIPAC 2 FIP	DGF Investimentos	3.677.083,03	0,03%	1,18%
DLM Brasil TI FIP	DLM Invista	16.209.845,66	0,14%	5,18%
FII Agências Caixa	Rio Bravo	31.680.000,00	0,27%	10,13%
FIP Brasil Energia	BTG Pactual	92.713.465,70	0,78%	29,64%
FIP Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	31.876.477,04	0,27%	10,19%
Mellon GTD FIP	BNY Mellon	2.476.148,69	0,02%	0,79%
Pátria Real Estate III FIP	Pátria Investimentos	18.897.888,08	0,16%	6,04%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA		100.075.299,84	0,84%	31,99%
FRG FIA - Q	QUEST Investimentos	44.787.171,84	0,38%	14,32%
FRG FIA - GAP	GAP Prudential LT	55.288.128,00	0,46%	17,67%
Total		11.019.820.660,27	92,62%	-

(**) 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			11.897.523.266,78	100,00%
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADC			10.707.004.024,23	89,99%
RENDA FIXA			8.454.794.272,79	71,06%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			8.125.494.977,46	68,30%
Notas do Tesouro Nacional			7.500.213.148,80	63,04%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			5.142.976.286,07	43,23%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		570.967	1.504.684.417,78	12,65%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		199.718	1.049.159.090,70	8,82%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)		331.258	875.694.047,60	7,36%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)		310.730	825.880.413,06	6,94%
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)		115.098	368.171.366,84	3,09%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2050)		190.691	515.143.958,75	4,33%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)		1.600	4.242.991,34	0,04%
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			2.357.236.862,73	19,81%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)		150.159	746.797.515,04	6,28%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)		326.916	734.188.925,72	6,17%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)		241.997	575.762.460,44	4,84%
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)		71.854	223.491.061,62	1,88%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)		9.223	23.583.178,94	0,20%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)		21.350	53.413.720,97	0,45%
Títulos da Dívida Agrária		12.121	1.134.840,25	0,01%
Operações Compromissadas (Adelic)		602.306	624.146.988,41	5,25%
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			329.299.295,33	2,77%
Letras Financeiras			45.321.794,68	0,38%
Safrá (Vencimento: 15/06/2015)		66	-	0,00%
CEF (Vencimento: 15/06/2015)		66	-	0,00%
Bradesco (Vencimento: 08/09/2023)		13	15.599.648,52	0,13%
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)		30	29.722.146,16	0,25%
Letras Financeiras Subordinadas			221.574.796,82	1,86%
Bradesco (Vencimento: 06/02/2018)		76	112.533.954,80	0,95%
Itaú (Vencimento: 06/02/2018)		76	109.040.842,02	0,92%
Debêntures Não Conversíveis			62.402.703,83	0,52%
BNDES Participações (Vencimento: 15/01/2017)		42.238	57.765.320,50	0,49%
Vale (Vencimento: 08/07/2050)		655.840	4.637.383,33	0,04%
RENDA VARIÁVEL			2.245.182.551,01	18,87%
Mercado à Vista			2.236.654.130,78	18,80%
AES Elpa	ON	333.918	3.806.665,20	0,03%
Bradesco	PN	11.971.235	341.180.197,50	2,87%
Brasil Seguridade	ON	7.803.100	266.085.710,00	2,24%
BRF - Brasil Foods	ON	2.989.814	196.370.983,52	1,65%
BM&FBovespa	ON	6.746.800	79.072.496,00	0,66%
CCR	ON	2.032.700	30.307.557,00	0,25%
Cielo	ON	3.085.610	135.211.430,20	1,14%
Fibra	ON	1.458.700	61.878.054,00	0,52%
Itausa	PN	14.855.583	132.363.244,53	1,11%
Itau Unibanco	PN	11.156.822	381.786.448,84	3,21%
Pão de Açúcar - CBD	PN	340.600	24.965.980,00	0,21%
Petrobras	ON	6.267.257	87.929.615,71	0,74%
Petrobras	PN	9.045.418	114.967.262,78	0,97%
Ultrapar Participações	ON	3.931.030	258.268.671,00	2,17%
Vale	ON	1.455.850	26.627.496,50	0,22%
Vale	PNA	2.436.600	37.962.228,00	0,32%
Weg	ON	3.037.800	57.870.090,00	0,49%
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			8.528.420,23	0,07%
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis		4.620	2.589.741,00	0,02%
Proman - Produtores Energéticos de Manso		2.000	5.938.679,23	0,05%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			7.027.200,43	0,06%

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			11.897.523.266,78	100,00%
CARTEIRA PRÓPRIA			1.190.519.242,55	10,01%
RENTA FIXA			37.206.244,32	0,31%
Certificados de Recebíveis Imobiliários			37.206.244,32	0,31%
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital			37.206.244,32	0,31%
RENTA VARIÁVEL			200,00	0,00%
Mercado à Vista			200,00	0,00%
Proman - Produtores Energéticos de Manso			200,00	0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA			100.075.299,84	0,84%
FRG FIA - Q			44.787.171,84	0,38%
FRG FIA - GAP			55.288.128,00	0,46%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			212.741.336,20	1,79%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP			15.210.428,00	0,13%
DGF FIPAC 2 FIP			3.677.083,03	0,03%
DLM Brasil TI FIP			16.209.845,66	0,14%
FII Agências Caixa			31.680.000,00	0,27%
FIP Brasil Energia			92.713.465,70	0,78%
FIP Brasil Petróleo 1			31.876.477,04	0,27%
Mellon GTD FIP			2.476.148,69	0,02%
Pátria Real Estate III FIP			18.897.888,08	0,16%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			572.310.725,24	4,81%
Edificações de Uso Próprio			46.720.239,79	0,39%
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ			46.720.239,79	0,39%
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			515.622.676,64	4,33%
Rodovia Presidente Dutra, 238 - Rio de Janeiro - RJ			14.437.466,61	0,12%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ			163.604.814,93	1,38%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ			112.035.073,45	0,94%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ			225.545.321,65	1,90%
Edificações para Renda			6.556.979,88	0,06%
Ed Parque das Palmeiras, R. Omar T. Castro, L88/90 Q5 - Angra dos Reis - RJ			6.556.979,88	0,06%
Valores a Receber			3.457.398,98	0,03%
Valores a Pagar			(46.570,05)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			268.167.414,12	2,25%
Valores a Receber			270.128.134,80	2,27%
Valores a Pagar			(1.960.720,68)	-0,02%
OUTROS REALIZÁVEIS			-	0,00%
Valores a Receber			-	0,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			18.022,83	0,00%
Valores a Receber			-	0,00%
Valores a Pagar			-	0,00%