

FUNDAÇÃO REAL GRANDEZA - PLANO DE BENEFÍCIO DEFINIDO
DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS
4º TRIMESTRE DE 2011

DISTRIBUIÇÃO DOS INVESTIMENTOS POR SEGMENTO

Segmento	2016		2015		Limites da Política de Investimentos
	R\$	Partic.	R\$	Partic.	
Renda Fixa	9.934.249.879,14	76,13%	8.588.622.694,74	76,05%	Até 100%
Renda Variável	2.026.628.629,71	15,53%	1.644.328.330,50	14,56%	Até 30%
Investimentos Estruturados	251.323.523,16	1,93%	231.449.068,14	2,05%	Até 18%
Investimentos no Exterior	-	0,00%	-	0,00%	Até 2%
Investimentos Imobiliários	544.346.770,62	4,17%	564.452.098,37	5,00%	Até 6%
Operações com Participantes	275.710.448,08	2,11%	254.421.912,18	2,25%	Até 6%
Caixa/Despesas a Pagar	17.614.336,55	0,13%	10.316.809,46	0,09%	-
Total de Investimentos	13.049.873.587,26	100,00%	11.293.590.913,39	100,00%	-

RENTABILIDADE DOS SEGMENTOS

Segmento	Rentabilidade no Ano	Benchmark	Rentabilidade do Benchmark no Ano
Renda Fixa	23,60%	-	-
Títulos a Mercado	28,94%	IMA	20,94%
Títulos na Curva	14,18%	INPC + 5,70%	12,66%
Renda Variável	35,26%	-	-
Carteira de Mercado	34,84%	IBrX	36,70%
Carteira de Ativos Diversos	87,01%	IBrX	36,70%
FRG FIA - ATIVO	29,02%	IBrX	36,70%
FRG FIA - GAP	37,62%	IBrX	36,70%
FRG FIA - VALOR	12,99%	IBrX	36,70%
Investimentos Estruturados	6,00%	IMA-B + 2%	27,26%
Investimentos Imobiliários	5,84%	IFIX	32,29%
Operações com Participantes	14,58%	INPC + 5,70% (*)	14,65%
Total	23,70%	INPC + 5,70%	12,66%

(*) De acordo com a Política de Investimentos, a variação do INPC + 5,70% 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		11.800.263.822,96	90,42%	-
Fundos Exclusivos		11.800.263.822,96	90,42%	-
FRG Plano BD FI Multimercado	Real Grandeza	11.800.263.822,96	90,42%	-
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS		251.323.523,16	1,93%	65,14%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP	BRZ Investimentos	33.011.257,52	0,25%	8,56%
DGF FIPAC 2 FIP	DGF Investimentos	10.960.516,47	0,08%	2,84%
ÓRIA TECH 1 FIP	DLM Private Equity	21.138.607,48	0,16%	5,48%
FII Agências Caixa	Rio Bravo	40.590.000,00	0,31%	10,52%
FIP Brasil Energia	BTG Pactual	92.030.795,31	0,71%	23,85%
FIP Brasil Petróleo 1	Mare e Mantiq	29.477.854,66	0,23%	7,64%
Pátria Real Estate III FIP	Pátria Investimentos	24.114.491,72	0,18%	6,25%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES - FIA		134.484.535,99	1,03%	34,86%
FRG FIA - ATIVO	Real Grandeza	49.963.914,22	0,38%	12,95%
FRG FIA - GAP	GAP Prudential LT	63.052.912,92	0,48%	16,34%
FRG FIA - VALOR	Real Grandeza	21.467.708,85	0,16%	5,56%
Total		12.186.071.882,11	93,38%	-

(**) 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			13.049.873.587,26	100,00%
FRG PLANO BD FI MULTIMERCADO			11.800.263.822,96	90,42%
RENDA FIXA			9.891.253.309,36	75,80%
Títulos Garantidos pelo Tesouro Nacional (Títulos Públicos)			9.457.595.056,09	72,47%
Notas do Tesouro Nacional			9.280.912.781,22	71,12%
Títulos Disponíveis para Negociação ("Títulos a Mercado")			5.953.810.717,10	45,62%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			310.730	7,25%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			570.967	13,43%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			331.258	7,81%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			190.691	4,59%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			96.558	2,32%
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			23.204	0,65%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			199.718	8,85%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			59.638	0,45%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2027)			37.644	0,28%
Títulos Mantidos Até o Vencimento ("Títulos na Curva")			3.327.102.064,12	25,50%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2024)			9.223	0,20%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2035)			326.916	6,29%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2045)			241.997	4,91%
NTN-B (Vencimento: 15/08/2050)			3.399	0,07%
NTN-B (Vencimento: 15/05/2055)			242.593	5,00%
NTN-C (Vencimento: 01/04/2021)			71.854	1,96%
NTN-C (Vencimento: 01/01/2031)			150.159	6,38%
NTN-F (Vencimento: 01/01/2025)			99.165	0,67%
Títulos da Dívida Agrária			1.206	0,00%
Operações Compromissadas (Adelic)			226.553	1,35%
Títulos emitidos por Empresas/Cotas de Fundos (Títulos Privados)			433.658.253,27	3,32%
Letras Financeiras			84.432.415,15	0,65%
Bradesco (Vencimento: 08/09/2023)			13	0,15%
Bradesco (Vencimento: 06/09/2024)			30	0,29%
Bradesco (Vencimento: 22/09/2026)			25	0,20%
Letras Financeiras Subordinadas			277.768.231,86	2,13%
Itaú (Vencimento: 06/02/2018)			76	1,04%
Bradesco (Vencimento: 06/02/2018)			76	1,09%
Debêntures Não Conversíveis			71.457.606,26	0,55%
BNDES Participações (Vencimento: 15/01/2017)			42.238	0,52%
Vale (Vencimento: 08/07/2050)			655.840	0,03%
RENDA VARIÁVEL			1.892.143.893,72	14,50%
Mercado à Vista			1.883.971.470,73	14,44%
AES Elpa			4.344.273,18	0,03%
Banco do Brasil			57.359.780,00	0,44%
Bradesco			132.476.988,00	1,02%
Brasil Seguridade			72.494.015,80	0,56%
BRF - Brasil Foods			65.643.015,25	0,50%
BM&FBovespa			81.796.654,50	0,63%
CCR Rodovias			22.902.600,00	0,18%
Cielo			46.436.320,09	0,36%
CPFL Energia			80.490.992,20	0,62%
Itausa			121.935.660,12	0,93%
Itau Unibanco			323.989.825,15	2,48%
Klabin			15.523.871,80	0,12%
Kroton			62.975.145,61	0,48%
Lojas Renner			26.592.394,36	0,20%
Multiplan Emp Imobiliários			9.744.258,00	0,07%
Petrobras			126.928.286,10	0,97%
Petrobras			195.897.751,75	1,50%
Raiaadrogasil			128.103.834,98	0,98%
Suzano Papel			15.904.000,00	0,12%
Tran Paulista			18.691.122,84	0,14%
Ultrapar Participações			66.056.166,60	0,51%
Vale do Rio Doce			60.990.000,00	0,47%
Vale do Rio Doce			107.223.960,00	0,82%
Vivt - Telef Brasil			39.470.554,40	0,30%
Debêntures Conversíveis de Emissão Pública com Participação nos Lucros			8.172.422,99	0,06%
CRT - Concessionária Rio-Teresópolis			2.589.741,00	0,02%
Proman - Produtores Energéticos de Manso			5.582.681,99	0,04%

PLANO BD - DISTRIBUIÇÃO ANALÍTICA DOS INVESTIMENTOS

	Espécie	Quantidade	R\$	Partic.
TOTAL LÍQUIDO DOS INVESTIMENTOS			13.049.873.587,26	100,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			16.866.619,88	0,13%
CARTEIRA PRÓPRIA			1.249.609.764,30	9,58%
RENDA FIXA			42.996.569,78	0,33%
Certificados de Recebíveis Imobiliários			42.996.569,78	0,33%
CRI da 62ª Série da 1ª Emissão da RB Capital			42.996.569,78	0,33%
RENDA 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			134.484.535,99	1,03%
FRG FIA - ATIVO			49.963.914,22	0,38%
FRG FIA - GAP			63.052.912,92	0,48%
FRG FIA - VALOR			21.467.708,85	0,16%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS			251.323.523,16	1,93%
Brasil Portos e Ativos Logísticos FIP			33.011.257,52	0,25%
DGF FIPAC 2 FIP			10.960.516,47	0,08%
ÓRIA TECH 1 FIP			21.138.607,48	0,16%
FII Agências Caixa			40.590.000,00	0,31%
FIP Brasil Energia			92.030.795,31	0,71%
FIP Brasil Petróleo 1			29.477.854,66	0,23%
Pátria Real Estate III FIP			24.114.491,72	0,18%
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS			544.346.770,62	4,17%
Edificações de Uso Próprio			44.972.284,98	0,34%
Rua Mena Barreto, 143 - Rio de Janeiro - RJ			44.972.284,98	0,34%
Edificações Locadas à(s) Patrocinadora(s)			488.676.000,00	3,74%
Rodovia Presidente Dutra, 238 - Rio de Janeiro - RJ			8.636.000,00	0,07%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco A - Rio de Janeiro - RJ			156.400.000,00	1,20%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco B - Rio de Janeiro - RJ			107.225.000,00	0,82%
Rua Real Grandeza, 219, Bloco C - Rio de Janeiro - RJ			216.415.000,00	1,66%
Edificações para Renda			4.813.000,00	0,04%
Ed Parque das Palmeiras, R. Omar T. Castro, L88/90 Q5 - Angra dos Reis - RJ			4.813.000,00	0,04%
Valores a Receber			5.934.063,99	0,05%
Valores a Pagar			(48.578,35)	0,00%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES			275.710.448,08	2,11%
Saldo de Empréstimos			279.995.759,83	2,15%
Valores a Pagar/Receber			(4.285.311,75)	-0,03%
OUTROS REALIZÁVEIS			-	0,00%
Valores a Receber			-	0,00%
CAIXA/DESPESAS A PAGAR/RECEBER			747.716,67	0,01%
Valores a Receber			747.716,67	0,57%
Valores a Pagar			0,00	0,00%