

<u>Segmentos</u>			<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			12.745,95	0,002%
<u>Total do Disponível</u>			12.745,95	0,002%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		15.292.035,00	2,49%
<u>Total Operações com Participantes</u>			15.292.035,00	2,49%
<u>Fundos</u>				
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.766.494	552.849.732,78	89,90%
*Quimera - FI RF	Cota de Fundo	5.021.869	5.941.258,97	0,97%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	10.000	957.510,14	0,16%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	1.517.443	39.940.561,68	6,49%
<u>Sub-total</u>			599.689.063,57	97,52%
<u>Total Renda Fixa</u>			599.689.063,57	97,52%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			15.458,61	0,003%
<u>Total Exigível Operacional</u>			15.458,61	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			34.360,10	0,01%
<u>Total Exigível Contingencial</u>			34.360,10	0,01%
<u>Total Plano I</u>			614.944.025,81	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas	2766494
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		33.030.337,72	8.568,00	5,97%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		29.356.775,87	7.112,00	5,31%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		21.467.313,91	26.136,00	3,88%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		136.253.894,40	30.515,00	24,65%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		128.425.883,37	29.494,00	23,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	12.848.843,56	16,00	2,32%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		88.086.304,98	9.260,00	15,93%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		67.867.032,54	15.116,00	12,28%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		10.244.022,04	2.340,00	1,85%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		8.157.801,45	2.062,00	1,48%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		8.000.754,70	1.450,00	1,45%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		6.134.489,74	1.519,00	1,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	2.280.828,48	3,00	0,41%
Valores a receber	Valores a Receber		715.736,40		0,13%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.517,94		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-29.804,67		-0,01%
Total			552.849.732,78		100,00%

QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas	5021869
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021	-	2.156.889,77	199,95	36,30%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	235.323,76	1,12	3,96%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	230.233,95	4,60	3,88%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	221.851,70	4,33	3,73%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	1.435.953,63	1.748,24	24,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	158.133,16	3,07	2,66%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	156.911,14	3,07	2,64%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	127.786,41	2,51	2,15%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	118.706,77	11,72	2,00%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	117.033,65	0,56	1,97%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	106.260,52	109,12	1,79%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	76.878,08	7,53	1,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	74.886,54	0,14	1,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	68.054,66	0,42	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	64.077,42	1,26	1,08%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	62.913,72	63,91	1,06%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	58.488,83	59,16	0,98%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	55.885,12	1,12	0,94%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	43.575,79	4,47	0,73%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	37.867,39	0,14	0,64%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	36.686,61	0,14	0,62%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	35.534,75	0,14	0,60%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	30.034,58	0,14	0,51%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	29.258,41	0,14	0,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	28.726,32	0,56	0,48%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	27.085,64	5,44	0,46%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	26.080,41	34,05	0,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	22.074,09	0,14	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO. FI	21.793,50	0,14	0,37%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	17.927,52	1,81	0,30%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	15.895,99	16,33	0,27%
Debênture simples	LCAMA9	COMPANHIA DE LO	11.099,88	11,02	0,19%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	9.386,82	9,49	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	8.483,15	8,79	0,14%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES	6.287,40	6,28	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	4.166,56	0,42	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	2.475,43	0,28	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	1.314,80	0,00	0,02%
Total			5.941.258,97		100,01%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	1517443
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Operações Compromissadas	NTNB_15012014_15052023	-	3.428.579,67	895,89	8,58%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	-	2.470.065,39	674,32	6,18%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050	-	1.688.022,16	404,20	4,23%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022	-	1.442.424,54	416,14	3,61%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	8.582.827,48	10.449,41	21,49%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024	-	1.005.252,98	260,76	2,52%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045	-	979.019,58	236,19	2,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	934.893,78	4,40	2,34%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035	-	882.744,17	218,05	2,21%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023	-	4.338.530,89	403,50	10,86%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025	-	739.429,49	200,49	1,85%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021	-	702.260,95	211,83	1,76%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055	-	626.376,68	136,34	1,57%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030	-	602.373,31	145,93	1,51%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	-	572.162,79	139,57	1,43%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	497.890,11	9,67	1,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	494.042,52	9,67	1,24%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	-	495.469,02	125,24	1,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	487.818,92	0,48	1,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO C6 SA	481.021,42	0,48	1,20%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	375.491,31	379,82	0,94%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	349.654,39	1,34	0,88%
Valores a receber	Valores a Receber	-	326.433,09	0,00	0,82%
Operações Compromissadas	NTNB_15102003_15082024	-	310.225,83	77,42	0,78%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	298.496,38	303,21	0,75%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	288.036,19	5,64	0,72%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	273.484,22	5,47	0,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	267.545,15	1,24	0,67%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	-	268.038,17	66,37	0,67%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	240.567,24	247,07	0,60%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	198.853,34	39,95	0,50%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	188.065,85	0,46	0,47%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	186.607,62	18,58	0,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	182.600,48	0,39	0,46%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	176.634,72	181,38	0,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	172.439,41	0,24	0,43%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	155.099,75	3,04	0,39%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	156.648,06	156,53	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	150.216,22	2,97	0,38%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	144.702,30	2,87	0,36%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	138.619,54	2,77	0,35%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial	LOCALIZA	123.906,63	0,12	0,31%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	125.304,89	12,28	0,31%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU SA	110.186,65	113,52	0,28%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022	-	105.986,71	9,84	0,27%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	106.149,71	105,32	0,27%
Debênture simples	SSED	SABER SERVIÇOS	104.668,39	10,51	0,26%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	105.208,53	105,32	0,26%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	105.171,52	11,86	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	98.254,23	0,37	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	96.889,77	1,92	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	95.681,93	1,90	0,24%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	91.404,57	90,37	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	82.977,21	0,31	0,21%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	83.718,56	84.024,05	0,21%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB	78.284,46	95,75	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	77.977,04	0,29	0,20%

Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	77.307,76	76,86	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	76.934,96	1,49	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	76.647,90	1,53	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	76.272,16	1,49	0,19%
Debênture simples	ELEK18	ELEKTRO S/A	75.103,92	74,15	0,19%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022	-	73.531,00	6,83	0,18%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	72.037,40	71,29	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	66.470,46	68,88	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	61.964,07	0,24	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	60.999,28	58,33	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	60.976,29	58,32	0,15%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	59.352,13	5,86	0,15%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	58.756,96	5,62	0,15%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	56.480,70	56,58	0,14%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	56.984,69	57,60	0,14%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	54.364,32	70,97	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	51.597,11	0,31	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	49.743,61	49,65	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	48.284,93	0,17	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	46.998,79	0,20	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	43.082,23	0,19	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	42.997,59	0,25	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	42.564,28	0,85	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	38.718,02	3,89	0,10%
Debênture simples	SBSPB3	SABESP	37.092,79	38,14	0,09%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	34.406,83	3,30	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	34.391,55	0,15	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	33.799,45	0,12	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	33.799,45	0,12	0,08%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES S	32.266,12	32,22	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	31.332,53	0,14	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	30.484,67	30,44	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RABOBANK	30.590,36	0,20	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	30.137,96	29,78	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	28.644,98	0,14	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	27.921,66	0,17	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	27.647,10	0,15	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A	27.542,39	27,33	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	27.247,58	27,06	0,07%
Debênture simples	SULM18	Sul América SA	27.241,67	27,21	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	27.182,64	26,64	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	26.850,51	0,53	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	26.347,19	0,12	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	24.561,25	2,48	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025	-	24.309,78	22,08	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	24.234,63	23,97	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	23.864,01	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	22.883,10	0,14	0,06%
Debênture simples	SEDU	Somos Educação	22.166,52	21,88	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	21.321,03	0,42	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	20.583,67	0,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	20.254,01	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	18.635,42	0,07	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	18.364,24	18,24	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	17.903,12	0,08	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	15.841,22	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	15.366,15	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	14.485,48	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	14.485,48	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	13.829,53	0,05	0,03%

Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	13.295,02	1,34	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.423,62	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	9.656,99	0,03	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	7.945,08	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	7.683,07	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.609,84	0,02	0,01%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	354,23	0,00	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22	-	-13,30	-0,15	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25	-	33,12	0,27	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-340.902,44	0,00	-0,85%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F23	-	-2.146,13	-11,09	-0,01%
Total			39.940.561,68		100,00%