

mar/21

<u>Segmentos</u>			<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			6.783,34	0,001%
Total do Disponível			6.783,34	0,001%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		14.784.701,61	2,44%
Total Operações com Participantes			14.784.701,61	2,44%
<u>Fundos</u>				
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.762.722	544.212.804,97	89,83%
*Quimera - FI RF	Cota de Fundo	5.021.869	5.954.949,93	0,98%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	10.000	959.701,22	0,16%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	1.517.443	39.940.911,15	6,59%
Sub-total			591.068.367,27	97,57%
Total Renda Fixa			591.068.367,27	97,57%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			29.610,51	0,005%
Total Exigível Operacional			29.610,51	0,005%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			34.641,85	0,01%
Total Exigível Contingencial			34.641,85	0,01%
Total Plano I			605.795.599,86	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas 2762722
Renda Fixa	

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		33.060.403,57	8.568,00	6,1%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		29.009.777,28	7.112,00	5,3%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		134.747.923,20	30.515,00	24,8%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		127.446.875,19	29.494,00	23,4%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		13.151.871,36	3.334,00	2,4%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	12.877.852,08	16,00	2,4%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		11.073.941,51	2.768,00	2,0%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		86.160.122,38	9.260,00	15,8%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		66.777.023,46	15.116,00	12,3%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		10.709.267,85	13.286,00	2,0%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		10.139.943,19	2.340,00	1,9%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		8.212.005,94	1.450,00	1,5%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	2.277.387,09	3,00	0,4%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.028,23		0,0%
Valores a receber	Valores a Receber		206,79		0,0%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-1.440.824,15		-0,3%
Total			544.212.804,97		100,0%

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

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	238.105,96	1,13	4,00%
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021	-	2.154.294,75	199,28	36,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	233.114,19	4,65	3,91%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	224.594,48	4,37	3,77%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	1.469.640,73	1.823,25	24,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	159.859,40	3,10	2,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	158.673,88	3,10	2,66%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	129.346,17	2,54	2,17%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	120.239,01	11,83	2,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	118.412,47	0,56	1,99%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	108.396,97	110,13	1,82%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	76.484,70	7,61	1,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	75.744,69	0,14	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	64.898,24	1,27	1,09%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	63.790,47	64,50	1,07%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	59.119,05	59,71	0,99%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	56.534,58	1,13	0,95%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	44.382,54	4,51	0,75%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	38.021,15	0,14	0,64%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	37.103,15	0,14	0,62%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	35.537,93	0,14	0,60%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	30.391,13	0,14	0,51%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	29.603,12	0,14	0,50%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	29.051,60	0,56	0,49%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	27.394,71	5,49	0,46%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	26.410,47	34,36	0,44%
Debênture simples	KLBNA2	KLABIN S/A	24.466,12	2,54	0,41%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	22.369,38	0,14	0,38%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO. FI	22.070,41	0,14	0,37%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	18.104,90	1,83	0,30%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	16.180,68	16,48	0,27%
Debênture simples	LCAMA9	COMPANHIA DE LO	11.249,75	11,13	0,19%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	9.502,27	9,58	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	8.657,65	8,87	0,15%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES	6.371,72	6,34	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	4.222,93	0,42	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	2.520,98	0,28	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	1.306,03	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber	-	8,27	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-1.226,69	0,00	-0,02%
Total			5.954.949,93	0,00	100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO	QT de Cotas	1517443
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	-	2.452.113,60	635,70	6,14%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050	-	1.653.602,16	374,32	4,14%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022	-	1.444.835,96	385,34	3,62%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	11.945.539,51	14.819,73	29,91%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024	-	1.134.466,55	294,01	2,84%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045	-	963.411,50	218,17	2,41%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	912.682,33	4,29	2,29%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035	-	871.510,36	203,34	2,18%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023	-	4.236.861,18	393,14	10,61%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025	-	735.770,29	186,17	1,84%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055	-	704.117,29	157,08	1,76%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021	-	698.825,16	192,80	1,75%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030	-	635.321,30	155,75	1,59%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	-	570.287,47	131,61	1,43%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	-	536.251,44	135,94	1,34%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	525.748,92	10,49	1,32%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	485.873,21	9,42	1,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	482.269,98	9,42	1,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	476.985,25	0,46	1,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO C6 SA	470.127,29	0,46	1,18%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	409.388,94	413,51	1,02%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	-	377.284,81	94,30	0,94%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	341.074,47	1,31	0,85%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	292.162,00	295,42	0,73%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	281.609,26	5,49	0,71%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	267.304,24	5,33	0,67%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	236.384,98	240,72	0,59%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	194.148,78	38,93	0,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	182.732,12	0,45	0,46%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	182.140,27	18,11	0,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	178.383,68	0,38	0,45%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	173.938,42	176,72	0,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	168.179,18	0,23	0,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	151.711,10	2,96	0,38%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	153.177,53	152,51	0,38%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	146.815,49	2,90	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	144.435,48	2,88	0,36%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	141.676,52	2,80	0,35%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	135.377,20	2,70	0,34%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Comercial	LOCALIZA	121.124,38	0,12	0,30%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	120.341,19	11,97	0,30%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU SA	109.449,05	110,61	0,27%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022	-	103.535,36	9,58	0,26%
Debênture simples	SSED	SABER SERVIÇOS	102.360,07	10,24	0,26%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	103.403,15	102,61	0,26%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	103.392,93	11,55	0,26%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	101.199,78	102,61	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	95.924,31	0,36	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	94.770,81	1,87	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	93.509,18	1,85	0,23%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	90.574,18	88,05	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	80.425,34	0,30	0,20%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	81.491,82	81.865,79	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	76.167,85	0,28	0,19%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	75.573,91	74,89	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	75.108,30	1,46	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	74.974,03	1,49	0,19%

Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB	74.592,25	93,29	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	74.611,29	1,46	0,19%
Debênture simples	ELEK18	ELEKTRO S/A	73.424,31	72,24	0,18%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022	-	71.811,71	6,65	0,18%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	70.427,79	69,46	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	65.485,55	67,11	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	60.443,58	0,23	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	59.588,28	56,83	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	59.565,82	56,82	0,15%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	58.033,72	5,71	0,15%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	57.396,22	5,48	0,14%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	55.286,21	55,13	0,14%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	55.685,42	56,12	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	50.368,27	0,30	0,13%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	53.143,48	69,15	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	48.700,67	48,38	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	45.902,15	0,20	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	45.548,60	0,17	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	42.076,97	0,18	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	41.973,56	0,25	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	41.610,22	0,83	0,10%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	37.881,12	3,79	0,09%
Debênture simples	SBSPB3	SABESP	36.261,19	37,16	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	33.578,59	0,15	0,08%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	33.631,45	3,21	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	31.884,02	0,12	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	31.884,02	0,12	0,08%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES S	31.565,07	31,40	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	30.601,43	0,13	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	30.123,28	29,01	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RABOBANK	29.892,71	0,20	0,07%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPOL MET	29.486,49	29,66	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	28.022,08	0,13	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A	27.090,87	26,63	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	27.259,47	0,17	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	26.987,95	0,15	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	26.657,94	26,36	0,07%
Debênture simples	SULM18	Sul América SA	26.630,69	26,51	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	26.596,90	25,95	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	26.256,66	0,51	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	25.731,43	0,12	0,06%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	24.156,72	2,42	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	23.487,91	23,35	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025	-	23.257,31	21,52	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	23.313,24	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	22.341,72	0,13	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	20.840,85	0,41	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	20.100,83	0,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	19.771,82	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	18.067,62	0,07	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	17.960,42	17,78	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	17.513,80	0,08	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	15.355,52	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	14.893,58	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.664,58	0,05	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.664,58	0,05	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	13.404,22	0,05	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	13.022,75	1,31	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.045,08	0,03	0,03%
Valores a receber	Valores a Receber	-	6.398,39	0,00	0,02%

Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	9.109,72	0,03	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	7.761,71	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	7.446,79	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.468,07	0,02	0,01%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	863,10	0,00	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F23	-	630,38	11,02	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22	-	10,83	0,15	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25	-	-10,91	-0,26	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-24.179,80	0,00	-0,06%
Total			39.940.911,15		100,00%