

<u>Segmentos</u>			<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			6.617,10	0,001%
Total do Disponível			6.617,10	0,001%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		14.068.744,18	2,27%
Total Operações com Participantes			14.068.744,18	2,27%
<u>Fundos</u>				
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.754.153	558.827.640,17	90,12%
*Quimera - FI RF	Cota de Fundo	5.021.869	5.991.024,43	0,97%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	10.000	947.214,76	0,15%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	1.517.443	40.326.429,70	6,50%
Sub-total			606.092.309,06	97,74%
Total Renda Fixa			606.092.309,06	97,74%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			21.316,38	0,003%
Total Exigível Operacional			21.316,38	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			35.072,54	0,01%
Total Exigível Contingencial			35.072,54	0,01%
Total Plano I			620.111.281,42	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas	2754153
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		33.743.369,07	8.568,00	6,0%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		29.396.436,67	7.112,00	5,3%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		23.498.138,71	28.683,00	4,2%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		134.629.293,06	30.515,00	24,1%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		125.254.562,28	29.494,00	22,4%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		13.410.643,97	3.334,00	2,4%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	13.029.353,45	16,00	2,3%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		11.288.193,84	2.768,00	2,0%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		92.214.949,42	9.260,00	16,5%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		68.338.829,36	15.116,00	12,2%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		10.308.832,45	2.340,00	1,8%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	2.320.296,52	3,00	0,4%
Valores a receber	Valores a Receber		1.419.059,48		0,3%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.418,63		0,0%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-33.736,74		0,0%
Total			558.827.640,17		100,0%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	1517443
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	-	2.899.316,20	759,50	7,19%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	1.687.843,57	2.060,27	4,19%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050	-	1.679.938,69	373,29	4,17%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022	-	1.431.482,05	381,52	3,55%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024	-	1.410.321,31	358,96	3,50%
Operações Compromissadas	LFT_08072016_01092022	-	8.414.275,96	776,42	20,87%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	969.614,55	4,52	2,40%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045	-	953.471,92	216,11	2,36%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035	-	849.513,04	200,89	2,11%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023	-	4.490.901,79	414,85	11,14%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055	-	779.509,09	174,04	1,93%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030	-	773.952,64	187,25	1,92%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	-	747.440,28	187,44	1,85%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025	-	723.993,03	186,30	1,80%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	-	625.949,37	142,08	1,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	557.283,58	11,07	1,38%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	515.382,27	9,94	1,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	512.583,82	9,94	1,27%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	-	511.998,20	125,55	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	507.157,19	0,49	1,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO C6 SA	499.464,96	0,49	1,24%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	435.061,38	436,35	1,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	361.807,85	1,38	0,90%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	305.966,02	311,74	0,76%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	299.355,91	5,80	0,74%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	283.347,86	5,62	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	274.684,35	5,47	0,68%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	252.394,81	254,02	0,63%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	206.193,30	41,08	0,51%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	194.657,42	0,47	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	190.745,16	0,40	0,47%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	185.472,29	186,49	0,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	180.744,72	0,24	0,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	162.454,27	3,23	0,40%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	161.406,96	3,13	0,40%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	160.523,55	160,94	0,40%
Valores a receber	Valores a Receber	-	157.042,73	0,00	0,39%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Comercial	COMPANHIA DE TR	157.478,08	0,10	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	156.061,70	3,06	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	153.717,25	3,04	0,38%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	150.948,72	2,95	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	144.131,63	2,85	0,36%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Comercial	LOCALIZA	128.886,29	0,12	0,32%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	127.766,32	12,63	0,32%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU SA	115.027,73	116,72	0,29%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022	-	109.763,81	10,11	0,27%
Debênture simples	EKTR19	ELEKTRO S/A	107.413,96	107,16	0,27%
Debênture simples	SSED	SABER SERVIÇOS	108.847,04	10,81	0,27%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	109.821,24	108,28	0,27%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	108.029,15	108,28	0,27%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	110.250,49	12,19	0,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	101.750,21	0,38	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	100.822,78	1,97	0,25%
Debênture simples	Debêntures	REDE D'OR SAO L	100.854,33	100,75	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	99.481,58	1,96	0,25%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	95.287,86	19,11	0,24%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	94.344,94	92,91	0,23%

Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	88.526,48	0,31	0,22%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	86.526,17	86.387,90	0,21%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	81.031,52	79,03	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	80.854,97	0,30	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	79.869,04	1,54	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	79.767,42	1,57	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	79.264,39	1,54	0,20%
Debênture simples	ELEK18	ELEKTRO S/A	76.613,14	76,23	0,19%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022	-	76.165,52	7,02	0,19%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB	74.875,90	98,45	0,19%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	73.701,95	73,30	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	69.874,07	70,82	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	64.846,23	1,29	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	64.117,85	0,24	0,16%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	61.681,06	6,03	0,15%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	59.583,83	5,78	0,15%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	58.770,55	58,17	0,15%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	58.925,82	59,22	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	53.523,53	0,31	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	50.932,54	51,05	0,13%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	52.317,40	72,97	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	49.517,00	0,17	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	44.602,94	0,26	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	44.349,49	0,87	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	40.399,05	4,00	0,10%
Debênture simples	SBSPB3	SABESP	38.086,21	39,21	0,09%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	35.818,68	3,39	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	35.628,97	0,16	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	35.041,41	0,70	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	34.661,90	0,12	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	34.661,90	0,12	0,09%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES S	33.716,45	33,13	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RABOBANK	31.805,68	0,21	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	31.439,62	30,62	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	31.343,94	31,30	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	30.029,83	0,14	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	28.930,32	0,17	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A	28.913,84	28,10	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	28.653,46	0,16	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	28.773,32	27,82	0,07%
Debênture simples	SULM18	Sul América SA	28.363,53	27,98	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	27.770,35	27,38	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	27.930,27	0,54	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	27.333,99	0,12	0,07%
Debênture simples	CEEBO0	COELBA	25.402,58	2,55	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	24.951,50	24,64	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	24.925,95	0,05	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025	-	25.009,48	22,70	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	23.706,21	0,14	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	22.170,43	0,44	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	21.337,99	0,09	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	20.988,51	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	19.851,87	0,07	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	19.104,14	18,76	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	18.768,65	0,09	0,05%

QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

QT de Cotas 18908989

Renda Fixa

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021	-	8.058.090,91	741,96	35,72%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	891.828,50	4,19	3,95%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	871.860,81	17,30	3,86%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	841.681,41	16,25	3,73%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	4.846.835,79	5.916,29	21,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	598.286,28	11,54	2,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	595.037,68	11,54	2,64%
Títulos Públicos	LFT_08032019_01092025	-	517.943,04	48,24	2,30%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	485.042,78	9,44	2,15%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	450.900,96	44,05	2,00%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	443.322,63	2,10	1,97%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	407.816,72	410,05	1,81%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	395.013,81	7,87	1,75%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	286.510,80	28,32	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	283.522,77	0,52	1,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	243.412,77	4,72	1,08%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	235.705,45	240,15	1,04%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	221.669,62	222,33	0,98%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	212.403,27	4,19	0,94%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	165.224,23	16,78	0,73%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	147.662,38	0,52	0,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	141.056,14	0,52	0,63%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	138.861,48	0,52	0,62%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	114.054,16	0,52	0,51%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	110.830,65	0,52	0,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	108.999,61	2,10	0,48%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	102.652,85	20,45	0,46%
Debênture simples	KLBNA2	KLABIN S/A	91.910,77	9,44	0,41%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	91.735,35	127,94	0,41%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	84.515,20	0,52	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO. FI	82.742,02	0,52	0,37%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	67.657,39	6,82	0,30%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	60.956,73	61,35	0,27%
Debênture simples	LCAMA9	COMPANHIA DE LO	42.842,06	41,42	0,19%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	35.477,73	35,66	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	32.593,79	33,03	0,14%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES	24.013,54	23,60	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	15.890,07	1,57	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	9.484,71	1,05	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	4.929,47	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber	-	915,83	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-3.714,13	0,00	
Total			22.558.178,03		