

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			6.855,57	0,001%
Total do Disponível			6.855,57	0,001%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		17.467.963,40	2,89%
Total Operações com Participantes			17.467.963,40	2,89%
<u>Fundos</u>				
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.907.365,0101	560.832.426,43	92,74%
*Quimera FI RF	Cota de Fundo	5.021.869,1250	5.869.427,50	0,97%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	10.000,0000	1.098.765,70	0,18%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	743.490,4302	19.344.318,95	3,20%
Sub-total			587.144.938,58	97,09%
Total Renda Fixa			587.144.938,58	97,09%
Depósito Judiciais/Recursois			149.268,90	0,02%
Total Depósito Judicial/Recursoal			149.268,90	0,02%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos	Empréstimos		14.628,46	0,002%
Total Exigível Operacional			14.628,46	0,002%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			32.614,07	0,01%
Total Exigível Contingencial			32.614,07	0,01%
Total Plano I			604.721.783,92	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas	2907365
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025		37.580.829,33	32.135,00	6,70%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		31.196.036,75	7.800,00	5,56%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		29.885.017,29	6.926,00	5,33%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		132.601.967,97	29.054,00	23,64%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		130.253.271,37	29.400,00	23,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	12.243.072,51	16,00	2,18%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		75.884.621,35	9.260,00	13,53%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		71.745.270,08	15.116,00	12,79%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		10.145.193,99	2.221,00	1,81%
Títulos Públicos	NTNB_14012009_15082020		8.564.039,42	2.516,00	1,53%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		6.814.264,11	1.450,00	1,22%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		5.437.287,39	1.314,00	0,97%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		5.431.895,22	1.280,00	0,97%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	2.183.020,52	3,00	0,39%
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB	1.029.326,77	2.000,00	0,18%
Debênture simples	RDCO24	ROD DAS COLINAS	335.011,89	100,00	0,06%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.629,70		0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		8.003,70		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-515.332,93		-0,09%
Total			560.832.426,43		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	743490
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Valores a receber	Valores a Receber		259,99	0,00	0,00%
Disponibilidades	Disponibilidade		115,03	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-67.416,51	0,00	-0,35%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		6.479.371,89	607,50	33,49%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		1.629.028,20	431,93	8,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	472.937,99	2,25	2,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	328.617,56	1,94	1,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	256.410,11	1,51	1,33%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	251.481,79	4,95	1,30%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	249.809,09	4,95	1,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	244.919,62	0,24	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	176.307,45	0,69	0,91%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	175.009,54	1,03	0,90%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participaçõ	359.470,88	35,18	1,86%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	145.470,32	2,89	0,75%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	135.511,43	0,64	0,70%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	206.863,61	20,48	1,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	93.018,49	0,24	0,48%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	152.099,33	15,29	0,79%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	91.932,44	0,20	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	86.993,61	0,12	0,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	78.426,60	1,56	0,41%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	120.658,09	126,62	0,62%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	68.851,60	70,24	0,36%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	119.549,99	124,51	0,62%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	193.369,14	194,66	1,00%
Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note					
Títulos de Crédito Privado		LOCALIZA	62.284,75	0,06	0,32%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	94.514,95	9,52	0,49%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	56.698,08	58,18	0,29%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	63.909,10	6,29	0,33%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	64.037,00	6,43	0,33%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		53.789,18	5,04	0,28%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	50.245,65	125,27	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	49.734,47	0,19	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	47.366,00	0,16	0,24%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	46.180,22	49,07	0,24%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	84.608,85	84,46	0,44%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	53.857,31	53,98	0,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	39.406,70	0,15	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	38.939,93	0,77	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	38.530,21	0,77	0,20%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		37.339,58	3,50	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	35.226,98	0,22	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	33.452,99	35,30	0,17%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	41.562,22	43.062,52	0,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	31.244,36	0,12	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	30.841,29	29,90	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	30.829,73	29,89	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	27.526,21	0,17	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	26.101,55	0,16	0,13%
Debênture simples	LAMEA2	LOJAS AMERICANA	37.235,83	3,84	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	24.910,46	0,09	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	24.461,08	0,15	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	23.763,12	0,10	0,12%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	51.572,79	53,98	0,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	21.782,86	0,10	0,11%

Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	21.751,29	0,13	0,11%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	45.388,21	4,49	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	20.667,69	0,10	0,11%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	60.392,01	6,08	0,31%
Debênture simples	SBSPB3	SABESP	18.316,03	19,54	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	17.437,32	0,06	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	17.383,57	0,08	0,09%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	62.557,46	65,84	0,32%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	17.013,01	16,94	0,09%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	28.811,47	29,52	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	15.842,08	0,07	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	15.558,00	15,60	0,08%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	29.701,10	36,37	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	14.120,03	0,09	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	13.956,16	0,08	0,07%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		13.543,05	11,32	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	13.567,77	0,27	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	13.313,41	0,06	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	12.985,72	12,54	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	12.985,53	12,54	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	12.785,73	0,08	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	12.522,87	1,27	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	12.191,19	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	12.013,92	0,03	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	11.973,13	12,28	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	11.564,67	0,07	0,06%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	19.664,72	1,99	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	10.403,00	0,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	10.245,53	0,02	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	10.159,33	0,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	10.128,31	9,91	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	10.128,31	9,91	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	9.124,39	0,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	8.784,78	0,02	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	7.894,33	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	7.473,14	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	7.043,53	0,04	0,04%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	6.668,50	0,69	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	6.440,84	0,02	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	5.894,49	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	4.982,09	0,02	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.393,72	0,01	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	2.635,43	0,01	0,01%
Operações Compromissadas	LFT_14072017_01092023		1.020,02	0,10	0,01%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F23		13,41	2,52	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22		-2,20	-0,08	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		-11,31	-0,15	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F22		-295,26	-11,90	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		954.918,77	201,19	4,94%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		538.905,49	134,74	2,79%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		538.501,59	117,99	2,78%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		493.604,18	128,71	2,55%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		481.744,73	108,74	2,49%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		379.804,58	108,03	1,96%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		313.288,11	68,59	1,62%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		313.088,45	65,15	1,62%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		273.873,53	325,98	1,42%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		264.389,54	61,27	1,37%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		249.931,32	60,40	1,29%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		181.375,15	45,35	0,94%

Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	144.889,15	34,14	0,75%
Títulos Públicos	NTNB_14012009_15082020	101.517,41	29,82	0,52%
Operações Compromissadas	NTNB_13102011_15082022	62.334,73	14,77	0,32%
Total		19.344.318,95		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		1.997.793,67	187,19	34,04%
Títulos Públicos	LFT_18072014_01092020		846.449,96	79,29	14,42%
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025		766.877,60	655,75	13,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	356.188,46	1,70	6,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	217.265,07	1,05	3,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	204.795,88	4,05	3,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	145.897,89	2,87	2,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	144.927,47	2,87	2,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	127.898,75	0,78	2,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	108.032,50	0,52	1,84%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	71.622,62	7,05	1,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	69.226,35	0,13	1,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	62.937,12	0,39	1,07%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	97.056,31	102,15	1,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	59.103,39	1,18	1,01%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	57.444,75	59,83	0,98%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	40.990,25	4,18	0,70%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	55.019,07	55,39	0,94%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	39.484,47	0,13	0,67%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	38.246,58	95,36	0,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	38.178,92	0,13	0,65%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	51.468,73	5,09	0,88%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	33.920,86	0,13	0,58%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	28.052,12	0,13	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	27.729,34	0,13	0,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	27.008,12	0,13	0,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	26.558,56	0,52	0,45%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	26.027,11	31,87	0,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO, FI	20.312,06	0,13	0,35%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	16.848,12	1,70	0,29%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS RENT A C	11.878,67	1,18	0,20%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	14.563,33	15,28	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	8.118,71	7,84	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	8.118,59	7,84	0,14%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	7.798,60	8,23	0,13%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	8.669,19	8,88	0,15%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	3.865,50	0,39	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	2.596,49	0,26	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade		1.326,68	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber		331,04	0,00	0,01%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-1.201,39	0,00	-0,02%
Total			5.869.427,50		100,00%