

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			13.051,44	0,002%
Total do Disponível			13.051,44	0,002%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		16.704.940,94	2,89%
Total Operações com Participantes			16.704.940,94	2,89%
<u>Fundos</u>				
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.792.323,3257	516.015.033,67	89,13%
*Quimera FI RF	Cota de Fundo	5.021.869,1250	5.888.369,24	1,02%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	10.000,0000	1.108.977,01	0,19%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	1.517.442,8015	39.143.150,19	6,76%
Sub-total			562.155.530,11	97,09%
Total Renda Fixa			562.155.530,11	97,09%
Depósito Judiciais/Recursois			149.268,90	0,03%
Total Depósito Judicial/Recursal			149.268,90	0,03%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos	Empréstimos		13.225,66	0,002%
Total Exigível Operacional			13.225,66	0,002%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			32.875,50	0,01%
Total Exigível Contingencial			32.875,50	0,01%
Total Plano I			578.976.690,23	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas 2792323
Renda Fixa	

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		129.815.280,06	30.466,00	25,16%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		123.313.015,58	29.400,00	23,90%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		78.958.214,40	9.260,00	15,30%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		64.829.636,82	15.116,00	12,56%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		30.136.181,22	7.800,00	5,84%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		28.086.235,82	6.926,00	5,44%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		21.576.298,24	26.467,00	4,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	12.400.055,39	16,00	2,40%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		9.310.605,49	2.221,00	1,80%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		7.333.214,28	1.450,00	1,42%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		5.188.413,56	1.314,00	1,01%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		5.149.649,10	1.280,00	1,00%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	2.205.696,80	3,00	0,43%
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB.	1.047.324,31	2.000,00	0,20%
Debênture simples	RDCO24	ROD DAS COLINAS	337.828,87	100,00	0,07%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.592,42		0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		229,76		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-3.682.438,45		-0,71%
Total			516.015.033,67		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	1517443
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		337,37	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		10.966,33	0,00	0,03%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-19.259,19	0,00	-0,05%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		11.589.227,86	1.087,15	29,61%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		6.316.020,10	7.747,67	16,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	849.231,82	4,04	2,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	451.992,48	8,86	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	448.430,07	8,86	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	440.962,66	0,44	1,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	317.395,05	1,23	0,81%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participaçõ	646.253,66	62,96	1,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	260.757,62	5,17	0,67%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	243.372,93	1,14	0,62%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	365.629,37	36,64	0,93%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	169.379,83	0,42	0,43%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	274.557,43	27,36	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	164.825,22	0,36	0,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	155.694,34	0,22	0,40%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	140.568,19	2,79	0,36%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	136.564,17	2,73	0,35%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	218.459,27	226,60	0,56%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	125.728,64	125,69	0,32%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	219.054,89	222,81	0,56%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	343.583,04	348,35	0,88%
Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note					
Títulos de Crédito Privado	LOCALIZA		112.214,29	0,11	0,29%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	171.292,57	17,04	0,44%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	101.378,26	104,12	0,26%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	113.179,15	11,26	0,29%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	114.213,75	11,51	0,29%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		96.461,21	9,02	0,25%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	90.344,00	224,18	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	89.318,68	0,34	0,23%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	80.282,60	87,82	0,21%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	152.117,77	151,15	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	76.271,59	0,28	0,19%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	95.331,10	96,59	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	70.773,62	0,26	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	69.877,89	1,37	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	69.168,80	1,37	0,18%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		66.899,29	6,26	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	63.270,97	0,39	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	60.663,69	63,17	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	56.247,22	0,22	0,14%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	74.287,64	77.062,43	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	55.386,52	53,50	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	55.366,34	53,48	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	46.861,93	0,28	0,12%
Debênture simples	LAMEA2	LOJAS AMERICANA	68.562,14	6,87	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	44.307,96	0,16	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	43.931,95	0,26	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	42.685,34	0,19	0,11%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	93.020,30	96,59	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	39.128,23	0,17	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	39.051,61	0,23	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	37.122,73	0,17	0,09%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	80.553,15	8,04	0,21%

Debênture simples	SBSBP3	SABESP	34.073,94	34,98	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	31.247,30	0,14	0,08%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	113.175,70	117,83	0,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	31.015,57	0,11	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	31.015,57	0,11	0,08%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	101.263,78	10,87	0,26%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	51.943,28	52,83	0,13%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	30.217,97	30,32	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	28.456,89	0,12	0,07%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	27.565,71	27,92	0,07%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	53.755,16	65,09	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	25.358,49	0,16	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	25.107,04	0,14	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	24.348,50	0,48	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	23.901,25	0,11	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		23.461,62	20,25	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	22.966,38	0,14	0,06%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	22.518,07	2,27	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	21.897,76	0,09	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	21.540,11	0,05	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	21.078,36	21,98	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	20.789,58	0,12	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	35.459,52	3,57	0,09%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	18.679,85	0,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	18.400,16	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	18.248,14	0,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	18.191,00	17,73	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	18.190,87	17,73	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	17.122,33	0,06	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	16.280,08	0,08	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	14.124,37	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.292,39	0,05	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.711,93	0,05	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	12.650,85	0,08	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	12.156,95	1,23	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	11.414,89	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	8.861,59	0,03	0,02%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F22		8.205,82	45,09	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	7.062,18	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.237,31	0,02	0,01%
Operações Compromissadas	LFT_14072017_01092023		831,27	0,08	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22		27,81	0,14	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		-94,36	-0,25	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.838.848,66	430,31	4,70%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		1.644.602,93	443,67	4,20%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		1.114.003,68	289,11	2,85%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		1.075.772,48	252,47	2,75%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		1.060.416,21	276,21	2,71%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		974.441,63	232,32	2,49%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		810.271,41	227,05	2,07%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		623.098,42	148,64	1,59%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		622.813,81	141,55	1,59%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		619.115,01	157,16	1,58%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		559.369,73	139,50	1,43%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		512.028,15	129,67	1,31%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		296.309,67	73,65	0,76%
Total			39.143.150,19	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		2.131.252,09	199,17	36,19%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		1.104.700,73	1.355,10	18,76%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	380.270,10	1,81	6,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	232.009,04	1,11	3,94%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	218.243,16	4,31	3,71%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	155.906,41	3,06	2,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	154.677,62	3,06	2,63%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	136.591,51	0,83	2,32%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	125.750,53	2,50	2,14%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	117.234,33	11,67	1,99%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	115.354,45	0,56	1,96%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	75.412,66	7,51	1,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	73.926,74	0,14	1,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	67.209,69	0,42	1,14%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	104.397,03	108,69	1,77%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	62.992,94	1,25	1,07%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	62.581,22	63,66	1,06%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	43.624,30	4,45	0,74%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	58.123,01	58,93	0,99%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	40.886,86	101,46	0,69%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	40.145,76	0,14	0,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	37.801,81	0,14	0,64%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	36.219,46	0,14	0,62%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	54.086,73	5,42	0,92%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	29.958,08	0,14	0,51%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	29.576,78	0,14	0,50%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	28.838,61	0,14	0,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	28.336,06	0,56	0,48%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	28.006,82	33,91	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	21.792,15	0,14	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO, FI	21.673,87	0,14	0,37%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	17.891,90	1,81	0,30%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS RENT A C	12.534,23	1,25	0,21%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	15.677,07	16,26	0,27%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	8.408,16	8,76	0,14%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	9.292,50	9,45	0,16%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	4.144,20	0,42	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	2.588,52	0,28	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade		1.310,04	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber		14,56	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-1.072,46	0,00	-0,02%
Total			5.888.369,24		100,00%