

<u>Segmentos</u>			<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			12.110,46	0,002%
<u>Total do Disponível</u>			12.110,46	0,002%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		14.469.348,08	2,36%
<u>Total Operações com Participantes</u>			14.469.348,08	2,36%
<u>Fundos</u>				
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.758.206	551.096.014,28	89,97%
*Quimera - FI RF	Cota de Fundo	5.021.869	5.971.369,14	0,97%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	10.000	944.467,35	0,15%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	1.517.443	40.103.545,73	6,55%
<u>Sub-total</u>			598.115.396,50	97,64%
<u>Total Renda Fixa</u>			598.115.396,50	97,64%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			19.716,16	0,003%
<u>Total Exigível Operacional</u>			19.716,16	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			34.939,77	0,01%
<u>Total Exigível Contingencial</u>			34.939,77	0,01%
<u>Total Plano I</u>			612.542.199,11	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas 2758206
Renda Fixa	

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		33.558.574,81	8.568,00	6,1%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		29.161.236,74	7.112,00	5,3%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		18.026.924,09	22.017,00	3,3%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		135.280.289,24	30.515,00	24,5%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		128.042.326,70	29.494,00	23,2%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		13.330.203,74	3.334,00	2,4%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	12.931.096,20	16,00	2,3%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		11.202.306,47	2.768,00	2,0%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		87.223.645,89	9.260,00	15,8%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		66.832.972,76	15.116,00	12,1%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		10.192.689,38	2.340,00	1,8%
Valores a receber	Valores a Receber		3.036.625,04		0,6%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	2.300.473,40	3,00	0,4%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.578,39		0,0%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-32.928,57		0,0%
Total			551.096.014,28		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	239.660,90	1,13	4,01%
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021	-	2.166.631,07	200,03	36,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	234.197,12	4,66	3,92%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	226.100,75	4,38	3,79%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	1.209.983,88	1.477,80	20,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	160.789,95	3,11	2,69%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	159.923,93	3,11	2,68%
Títulos Públicos	LFT_08032019_01092025	-	138.948,36	13,01	2,33%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	130.245,31	2,54	2,18%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	121.083,79	11,87	2,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	119.148,40	0,57	2,00%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	109.480,96	110,55	1,83%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	106.147,25	2,12	1,78%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	77.005,97	7,63	1,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	76.218,39	0,14	1,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	65.360,23	1,27	1,09%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	64.268,95	64,74	1,08%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	59.525,46	59,94	1,00%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	56.941,15	1,13	0,95%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	44.387,16	4,52	0,74%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	38.918,18	0,14	0,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	37.329,14	0,14	0,63%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	37.237,98	0,14	0,62%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	30.596,47	0,14	0,51%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	29.787,10	0,14	0,50%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	29.294,45	0,57	0,49%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	27.591,25	5,51	0,46%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	26.609,72	34,49	0,45%
Debênture simples	KLBNA2	KLABIN S/A	24.611,57	2,54	0,41%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	22.556,10	0,14	0,38%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO. FI	22.235,71	0,14	0,37%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	18.360,18	1,84	0,31%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	16.354,82	16,54	0,27%
Debênture simples	LCAMA9	COMPANHIA DE LO	11.521,71	11,17	0,19%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	9.629,21	9,61	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	8.739,64	8,91	0,15%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES	6.366,24	6,36	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	4.265,53	0,42	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	2.544,61	0,28	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	1.284,81	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber	-	427,73	0,00	0,01%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-941,97	0,00	
Total			5.971.369,14		

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	1517443
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Operações Compromissadas	NTNB_15102003_15082024	-	3.094.204,55	796,05	7,72%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	-	2.857.979,71	733,68	7,13%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050	-	1.625.584,75	367,67	4,05%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022	-	1.424.399,95	378,29	3,55%
Operações Compromissadas	LTN_08012021_01072024	-	8.235.629,60	10.535,42	20,54%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024	-	1.183.274,06	302,11	2,95%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045	-	946.325,31	213,46	2,36%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	910.834,79	4,26	2,27%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035	-	862.726,61	198,73	2,15%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023	-	4.219.200,37	390,90	10,52%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055	-	755.940,81	167,16	1,88%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025	-	731.866,82	182,57	1,82%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021	-	686.617,23	189,60	1,71%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030	-	656.993,87	160,23	1,64%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	-	589.541,56	135,34	1,47%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	-	588.264,91	147,13	1,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	523.205,92	10,43	1,30%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	484.107,81	9,36	1,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	481.500,40	9,36	1,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	475.911,72	0,46	1,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO C6 SA	468.885,84	0,46	1,17%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	-	420.600,36	103,93	1,05%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	408.328,65	411,16	1,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	339.795,79	1,30	0,85%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	291.586,62	293,74	0,73%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	280.946,56	5,46	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	266.021,56	5,30	0,66%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	257.881,71	5,15	0,64%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	236.683,04	239,35	0,59%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	193.703,60	38,70	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	182.655,57	0,44	0,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	178.570,64	0,38	0,45%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	174.026,49	175,72	0,43%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	168.799,91	0,23	0,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	152.546,00	3,04	0,38%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	151.416,18	2,95	0,38%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	152.827,95	151,64	0,38%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	146.444,62	2,88	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	144.177,87	2,86	0,36%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	141.418,36	2,78	0,35%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	135.068,88	2,68	0,34%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial	LOCALIZA	120.991,98	0,12	0,30%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	120.022,46	11,90	0,30%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU SA	109.267,56	109,98	0,27%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022	-	103.156,78	9,53	0,26%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	103.097,96	102,03	0,26%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	103.381,12	11,49	0,26%
Debênture simples	SSD	SABER SERVIÇOS	102.163,45	10,19	0,25%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	101.096,95	102,03	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	95.601,42	0,36	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	94.584,51	1,86	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	93.305,12	1,84	0,23%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	90.616,44	87,55	0,23%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	89.452,29	18,00	0,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	81.549,00	0,30	0,20%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	81.325,53	81.400,01	0,20%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	75.968,94	74,46	0,19%

Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	75.947,92	0,28	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	75.024,25	1,45	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	74.811,12	1,48	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	74.423,83	1,45	0,19%
Debênture simples	ELEK18	ELEKTRO S/A	73.291,15	71,83	0,18%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB	72.365,41	92,76	0,18%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022	-	71.556,94	6,62	0,18%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	69.124,07	69,07	0,17%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	65.484,35	66,73	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	60.216,98	0,23	0,15%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	57.892,12	5,68	0,14%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	57.328,24	5,45	0,14%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	55.134,22	54,82	0,14%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	55.898,89	55,80	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	50.277,86	0,30	0,13%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	53.041,09	68,75	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	47.797,67	48,10	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	45.995,02	0,16	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	45.754,26	0,20	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	41.941,40	0,18	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	41.898,22	0,25	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	41.513,22	0,82	0,10%
Debênture simples	SBSPB3	SABESP	36.210,61	36,94	0,09%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	37.903,60	3,77	0,09%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	36.215,67	44,23	0,09%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	33.622,24	3,19	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	33.468,22	0,15	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	32.981,97	0,66	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	32.196,51	0,12	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	32.196,51	0,12	0,08%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES S	31.241,48	31,22	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	30.502,84	0,13	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	30.088,15	28,85	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RABOBANK	29.828,00	0,20	0,07%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	29.427,86	29,49	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	27.992,60	0,13	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A	27.107,46	26,48	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	27.045,77	26,21	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	27.174,62	0,16	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	26.908,30	0,15	0,07%
Debênture simples	SULM18	Sul América SA	26.565,57	26,36	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	26.199,63	0,51	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	26.056,19	25,80	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	25.657,65	0,12	0,06%
Debênture simples	CEEBO0	COELBA	23.869,79	2,40	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	23.404,21	23,22	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025	-	23.464,67	21,39	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	23.336,65	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	22.268,38	0,13	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	20.796,11	0,41	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	20.036,76	0,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	19.718,82	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	18.303,73	0,07	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	17.923,49	17,67	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	17.495,37	0,08	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	15.639,09	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	15.101,67	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.798,51	0,05	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.798,51	0,05	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	13.591,50	0,05	0,03%

Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	13.005,21	1,30	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.202,49	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	9.199,00	0,03	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	7.769,50	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	7.550,83	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.530,50	0,02	0,01%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	356,90	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber	-	525,69	0,00	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1V23	-	137,55	0,92	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1J23	-	112,73	0,66	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1N24	-	90,89	0,53	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1N22	-	63,68	1,35	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25	-	50,82	0,26	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1N23	-	43,03	0,28	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1J22	-	36,26	1,25	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1V22	-	24,93	0,33	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F22	-	10,03	0,48	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F26	-	6,73	0,05	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1V21	-	0,10	0,18	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F24	-	-905,83	-6,43	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F23	-	-1.703,82	-12,39	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-17.496,85	0,00	-0,04%
Total			40.103.545,73		