

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			6.857,80	0,001%
Total do Disponível			6.857,80	0,001%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		17.195.631,62	2,89%
Total Operações com Participantes			17.195.631,62	2,89%
<u>Fundos</u>				
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.902.213,3920	551.212.415,12	92,68%
*Quimera FI RF	Cota de Fundo	5.021.869,1250	5.879.712,84	0,99%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	10.000,0000	1.103.713,73	0,19%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	743.490,4302	19.261.617,83	3,24%
Sub-total			577.457.459,52	97,09%
Total Renda Fixa			577.457.459,52	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		11.795,16	0,002%
Total Exigível Operacional			11.795,16	0,002%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			32.757,57	0,01%
Total Exigível Contingencial			32.757,57	0,01%
Total Plano I			594.764.665,11	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas	2902213
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025		42.399.452,85	32.135,00	7,69%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		30.364.917,76	7.800,00	5,51%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		28.630.873,14	6.926,00	5,19%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		133.343.985,17	29.054,00	24,19%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		126.460.428,32	29.400,00	22,94%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	12.389.532,55	16,00	2,25%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		77.228.343,46	9.260,00	14,01%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		66.971.642,80	15.116,00	12,15%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		9.587.966,07	2.221,00	1,74%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		7.012.053,30	2.516,00	1,27%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		5.235.676,73	1.450,00	0,95%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		5.215.684,16	1.314,00	0,95%
Valores a receber	Valores a Receber		2.810.410,66	1.280,00	0,51%
<a href="#" self" onclick="CallAjaxLinkText('L Letra Financeira		ITAU UNIBANCO S	2.207.495,51	3,00	0,40%
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB	1.038.752,57	2.000,00	0,19%
Debênture simples	RDCO24	ROD DAS COLINAS	336.242,68	100,00	0,06%
Disponibilidades	Disponibilidade		10.004,09		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-31.046,70		-0,01%
Total			551.212.415,12		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	743490
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		431,91	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		156,63	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-20.925,81	0,00	-0,11%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		6.467.917,90	605,45	33,58%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		1.626.066,86	438,83	8,44%
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025		831.377,25	721,95	4,32%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	472.144,82	2,25	2,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	251.202,71	4,94	1,30%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	249.354,38	4,94	1,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	244.841,61	0,24	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	176.382,37	0,69	0,92%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	174.723,50	1,02	0,91%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participaçõ	359.253,33	35,06	1,87%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	144.767,15	2,88	0,75%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	135.299,35	0,63	0,70%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	203.027,52	20,41	1,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	94.001,11	0,23	0,49%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	152.345,99	15,24	0,79%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	91.716,43	0,20	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	86.711,71	0,12	0,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	78.052,49	1,55	0,41%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	121.105,10	126,20	0,63%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	69.792,86	70,00	0,36%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	120.921,66	124,09	0,63%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	190.835,41	194,00	0,99%
Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note					
Títulos de Crédito Privado		LOCALIZA	62.237,80	0,06	0,32%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	94.649,61	9,49	0,49%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	56.502,10	57,98	0,29%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	64.192,86	6,27	0,33%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	63.383,54	6,41	0,33%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		53.694,95	5,02	0,28%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	50.195,95	124,85	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	49.651,82	0,19	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	46.965,63	0,16	0,24%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	45.517,03	48,91	0,24%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	84.525,92	84,18	0,44%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	53.757,57	53,79	0,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	39.346,89	0,15	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	38.844,80	0,76	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	38.460,86	0,76	0,20%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		37.274,24	3,49	0,19%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		35.224,21	42,39	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	35.168,68	0,22	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	33.625,71	35,18	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	31.257,64	0,12	0,16%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	41.398,55	42.917,57	0,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	30.771,32	29,79	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	30.760,12	29,79	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	26.055,78	0,16	0,14%
Debênture simples	LAMEA2	LOJAS AMERICANA	37.509,19	3,83	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	24.750,28	0,09	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	24.423,12	0,15	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	23.722,92	0,10	0,12%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	52.233,42	53,79	0,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	21.746,01	0,10	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	21.713,15	0,13	0,11%

Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	45.506,53	4,48	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	20.634,18	0,10	0,11%
Debênture simples	SBSBP3	SABESP	18.879,60	19,48	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	17.367,67	0,08	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	17.325,20	0,06	0,09%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	62.706,87	65,62	0,33%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	17.096,45	16,88	0,09%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	56.184,51	6,06	0,29%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	28.843,11	29,42	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	15.815,28	0,07	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	15.538,57	15,55	0,08%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	29.760,82	36,25	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	14.097,66	0,09	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	13.958,07	0,08	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	13.517,63	0,27	0,07%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		13.235,47	11,28	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	13.285,26	0,06	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	12.967,93	12,49	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	12.967,74	12,49	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	12.765,46	0,08	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	12.482,81	1,27	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	12.172,79	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	11.985,79	0,03	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	11.940,26	12,24	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	11.555,76	0,07	0,06%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	19.652,55	1,99	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	10.380,70	0,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	10.229,93	0,02	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	10.144,00	0,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	10.109,88	9,87	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	10.109,82	9,87	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	9.069,92	0,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	8.710,62	0,02	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	7.827,61	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	7.425,08	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	7.031,88	0,04	0,04%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	6.730,21	0,69	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	6.386,92	0,02	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	4.950,06	0,02	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.356,64	0,01	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	2.613,19	0,01	0,01%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F24		73,95	0,60	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22		-3,06	-0,08	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F22		-63,19	-3,10	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1J23		61,31	0,88	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1V23		43,37	0,42	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		26,55	0,15	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1N23		14,93	0,17	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		927.549,21	209,35	4,82%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		545.914,42	140,23	2,83%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		537.363,90	122,78	2,79%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		517.101,96	133,93	2,68%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		486.506,82	113,10	2,53%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		390.434,97	110,29	2,03%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		309.774,57	71,76	1,61%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		308.772,52	67,92	1,60%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		270.230,55	65,37	1,40%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		250.099,46	62,77	1,30%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		244.438,00	61,52	1,27%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		144.967,53	35,58	0,75%

Operações Compromissadas	NTNB_13102011_15082022	8.923,75	2,24	0,05%
Total		19.261.617,83		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		2.045.664,26	191,36	34,79%
Títulos Públicos	LFT_18072014_01092020		866.733,22	81,06	14,74%
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025		422.436,29	366,84	7,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	364.749,90	1,74	6,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	222.515,07	1,07	3,78%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	209.114,90	4,14	3,56%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	149.489,64	2,94	2,54%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	148.389,71	2,94	2,52%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	130.984,96	0,80	2,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	120.473,86	2,40	2,05%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	112.303,23	11,22	1,91%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	110.570,52	0,53	1,88%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	73.793,57	7,21	1,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	70.901,44	0,13	1,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	64.459,03	0,40	1,10%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	99.793,93	104,43	1,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	60.336,02	1,20	1,03%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	59.600,40	61,16	1,01%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	41.909,32	4,27	0,71%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	55.696,69	56,62	0,95%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	40.159,11	0,13	0,68%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	39.192,87	97,48	0,67%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	38.773,22	0,13	0,66%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	34.736,73	0,13	0,59%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	51.815,36	5,21	0,88%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	28.731,95	0,13	0,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	28.368,84	0,13	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	27.642,63	0,13	0,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	27.176,06	0,53	0,46%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	26.751,17	32,58	0,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO, FI	20.795,10	0,13	0,35%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	17.244,14	1,74	0,29%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS RENT A C	12.216,39	1,20	0,21%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	14.993,77	15,62	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	8.316,41	8,01	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	8.316,29	8,01	0,14%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	8.040,77	8,41	0,14%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	8.902,24	9,08	0,15%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	3.962,61	0,40	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	2.477,81	0,27	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade		1.316,57	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber		245,84	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-378,97	0,00	-0,01%
Total			5.879.712,84		100,00%