

jan/21

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>				
			12.387,58	0,002%
Total do Disponível			12.387,58	0,002%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		15.377.491,14	2,49%
Total Operações com Participantes			15.377.491,14	2,49%
<u>Fundos</u>				
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.770.951	556.022.919,65	89,91%
*Quimera - FI RF	Cota de Fundo	5.021.869	5.932.057,50	0,96%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	10.000	991.064,63	0,16%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	1.517.443	40.129.053,47	6,49%
Sub-total			603.075.095,25	97,52%
Total Renda Fixa			603.075.095,25	97,52%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			5.990,06	0,001%
Total Exigível Operacional			5.990,06	0,001%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			34.267,57	0,01%
Total Exigível Contingencial			34.267,57	0,01%
Total Plano I			618.424.716,34	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

QT de Cotas 2770951

Renda Fixa

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		31.296.485,25	30.466,00	5,63%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		29.993.227,47	29.400,00	5,39%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		26.654.572,90	9.260,00	4,79%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		138.625.101,28	15.116,00	24,93%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		131.657.197,48	7.800,00	23,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	12.860.191,13	6.926,00	2,31%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		84.462.660,40	29.581,00	15,19%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		71.132.183,19	16,00	12,79%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		10.188.143,47	2.221,00	1,83%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		7.810.141,27	1.450,00	1,40%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		5.430.099,23	1.280,00	0,98%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		5.412.648,15	1.314,00	0,97%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	2.281.066,82	3,00	0,41%
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB	1.091.053,64	2.000,00	0,20%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.710,55		0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		8.309,86		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-2.889.872,44		-0,52%
Total			556.022.919,65		100,00%

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	254.465,11	1,21	4,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	239.686,23	4,68	4,04%
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021	-	2.331.686,34	216,50	39,31%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	1.312.287,07	1.577,58	22,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	170.971,42	3,32	2,88%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	169.703,05	3,32	2,86%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	137.946,45	2,72	2,33%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	130.089,22	12,69	2,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	126.451,41	0,60	2,13%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	114.560,84	118,14	1,93%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	82.922,93	8,16	1,40%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	80.964,11	0,15	1,36%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	73.566,28	0,45	1,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	69.243,10	1,36	1,17%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	67.672,73	69,19	1,14%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	63.920,87	64,06	1,08%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	59.304,27	5,89	1,00%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	47.270,89	4,83	0,80%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	41.354,32	0,15	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	39.664,38	0,15	0,67%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	39.019,54	0,15	0,66%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	32.804,87	0,15	0,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	32.474,77	0,15	0,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	31.612,85	0,15	0,53%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	31.059,98	0,60	0,52%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	28.163,20	36,86	0,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	23.925,55	0,15	0,40%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO. FI	23.586,50	0,15	0,40%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	19.409,28	1,96	0,33%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	17.177,84	17,68	0,29%
Debênture simples	LCAMA9	COMPANHIA DE LO	11.981,74	11,94	0,20%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	10.127,01	10,27	0,17%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	9.151,76	9,52	0,15%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	4.495,61	0,45	0,08%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	2.857,74	0,30	0,05%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	1.437,72	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber	-	397,19	0,00	0,01%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-1.356,69	0,00	-0,02%
Total			5.932.057,50		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	1517443
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	1.900.531,62	2.247,46	4,74%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050	-	1.805.003,68	383,57	4,50%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	-	1.655.800,49	428,48	4,13%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023	-	12.605.892,64	1.174,93	31,41%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024	-	1.032.576,59	257,35	2,57%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045	-	1.022.619,61	224,74	2,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	938.090,46	4,43	2,34%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035	-	930.309,16	207,74	2,32%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022	-	4.488.880,46	1.172,76	11,19%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025	-	769.453,45	191,29	1,92%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021	-	701.384,06	196,34	1,75%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055	-	632.181,30	134,19	1,58%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030	-	624.104,47	144,12	1,56%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	-	622.922,32	135,80	1,55%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	-	511.465,16	123,77	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	498.874,24	9,72	1,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	495.620,48	9,72	1,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	488.086,46	0,48	1,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO C6 SA	481.642,87	0,48	1,20%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	403.806,52	40,19	1,01%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	380.581,86	382,11	0,95%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	350.613,21	1,35	0,87%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	295.640,88	305,04	0,74%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	288.367,77	5,67	0,72%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	-	276.676,39	65,43	0,69%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	268.333,43	1,25	0,67%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	240.969,84	248,56	0,60%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	188.285,62	0,46	0,47%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	186.978,11	18,70	0,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	183.086,90	0,39	0,46%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	178.561,43	182,47	0,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	173.500,81	0,24	0,43%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	156.556,65	157,47	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	155.258,19	3,06	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	150.295,72	2,99	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	144.634,25	2,89	0,36%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	125.240,71	12,36	0,31%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Comercial	LOCALIZA	124.091,25	0,12	0,31%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	113.279,95	11,21	0,28%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU SA	111.189,62	114,20	0,28%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	112.579,40	11,93	0,28%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022	-	106.329,13	9,89	0,26%
Debênture simples	SSED	SABER SERVIÇOS	106.034,15	10,58	0,26%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	106.301,92	105,95	0,26%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	103.974,30	105,95	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	98.539,44	0,38	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	96.971,80	1,93	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	95.727,90	1,91	0,24%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	91.246,44	90,91	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	84.710,67	0,31	0,21%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB	82.320,62	96,33	0,21%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	83.754,19	84.529,93	0,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	78.225,15	0,29	0,19%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	77.378,86	77,33	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	77.176,33	1,50	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	76.542,40	1,50	0,19%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022	-	73.776,17	6,87	0,18%

Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	71.548,51	71,72	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	69.810,10	0,43	0,17%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	67.181,07	69,30	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	62.133,99	0,24	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	61.105,00	58,67	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	61.128,03	58,68	0,15%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	60.143,75	5,90	0,15%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	57.307,33	56,92	0,14%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	57.090,08	57,95	0,14%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	54.177,65	71,40	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	51.782,72	0,31	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	49.667,52	49,95	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	49.053,35	0,17	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	47.113,10	0,20	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	43.187,01	0,19	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	43.152,27	0,26	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	40.960,64	0,19	0,10%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	39.053,47	3,76	0,10%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	38.756,28	3,91	0,10%
Debênture simples	SBSPB3	SABESP	37.105,07	38,36	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	34.488,15	0,15	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	34.337,34	0,12	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	34.337,34	0,12	0,09%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	34.348,03	3,32	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	31.408,73	0,14	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	30.582,11	30,62	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	30.096,12	29,96	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	28.884,81	0,14	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A	28.073,43	27,50	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	27.997,03	0,17	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	27.733,90	0,15	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	27.236,35	27,22	0,07%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025	-	26.774,85	22,22	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	26.971,74	26,80	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	26.893,11	0,53	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	26.410,32	0,12	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	24.633,84	2,49	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	24.270,53	24,11	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	23.926,30	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	22.946,47	0,14	0,06%
Debênture simples	SEDU	Somos Educação	22.169,33	22,01	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	20.630,12	0,09	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	20.314,81	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	19.001,44	0,07	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	18.367,51	18,35	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	18.053,01	0,09	0,04%
Operações Compromissadas	NTNB_06012016_15052021	-	21.457,80	6,01	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	16.108,55	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	15.687,16	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	14.716,00	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	14.716,00	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	14.118,45	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	13.958,33	0,09	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	13.318,96	1,35	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.667,62	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	9.810,67	0,03	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	7.843,58	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.706,15	0,02	0,01%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	394,45	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber	-	303,22	0,00	0,00%

Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F23	-	1.683,97	21,33	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22	-	4,38	0,15	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25	-	-28,07	-0,27	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-37.734,98	0,00	-0,09%
TOTAL		-	40.129.053,47	0,00	100,00%