

<u>Segmentos</u>			<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			18.598,28	0,003%
Total do Disponível			18.598,28	0,003%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		13.382.710,10	2,15%
Total Operações com Participantes			13.382.710,10	2,15%
<u>Fundos</u>				
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.751.224	562.433.553,46	90,25%
*Quimera - FI RF	Cota de Fundo	5.021.869	6.011.106,64	0,96%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	10.000	943.750,71	0,15%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	1.517.443	40.458.719,33	6,49%
Sub-total			609.847.130,14	97,86%
Total Renda Fixa			609.847.130,14	97,86%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			20.252,68	0,003%
Total Exigível Operacional			20.252,68	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			35.409,24	0,01%
Total Exigível Contingencial			35.409,24	0,01%
Total Plano I			623.192.776,60	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas	2751224
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		33.639.595,27	8.568,00	6,0%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		29.615.732,22	7.112,00	5,3%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		22.942.077,26	27.952,00	4,1%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		135.523.181,09	30.515,00	24,1%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		126.715.849,88	29.494,00	22,5%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		13.383.675,59	3.334,00	2,4%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	13.090.407,26	16,00	2,3%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		11.327.198,22	2.768,00	2,0%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		94.004.359,00	9.260,00	16,7%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		69.136.272,77	15.116,00	12,3%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		10.376.688,45	2.340,00	1,8%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	2.324.199,59	3,00	0,4%
Valores a receber	Valores a Receber		380.011,80		0,1%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.681,90		0,0%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-35.376,84		0,0%
Total			562.433.553,46		100,0%

QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas	5021869
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021	-	2.113.997,18	194,05	35,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	233.678,88	1,10	3,89%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	228.936,06	4,53	3,81%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	221.001,26	4,25	3,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	157.022,44	3,02	2,61%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	156.176,51	3,02	2,60%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	127.387,24	2,47	2,12%
Títulos Públicos	LFT_08032019_01092025	-	823.150,45	76,39	13,69%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	675.687,93	823,24	11,24%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	118.460,66	11,52	1,97%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	116.344,91	0,55	1,94%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	107.227,06	107,24	1,78%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	103.781,86	2,06	1,73%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	75.204,07	7,41	1,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	74.392,42	0,14	1,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	63.939,84	1,23	1,06%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	62.102,42	62,81	1,03%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	58.294,37	58,15	0,97%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	55.782,98	1,10	0,93%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	43.523,16	4,39	0,72%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	38.777,71	0,14	0,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	37.061,52	0,14	0,62%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	36.436,15	0,14	0,61%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	29.934,19	0,14	0,50%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	29.086,23	0,14	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	28.608,44	0,55	0,48%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	26.940,78	5,35	0,45%
Debênture simples	KLBNA2	KLABIN S/A	24.212,76	2,47	0,40%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	24.134,06	33,46	0,40%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	22.190,56	0,14	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO. FI	21.720,02	0,14	0,36%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	17.767,02	1,78	0,30%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	15.801,46	16,05	0,26%
Debênture simples	LCAMA9	COMPANHIA DE LO	11.246,89	10,83	0,19%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	9.320,31	9,33	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	8.562,10	8,64	0,14%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES	6.314,83	6,17	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	4.116,46	0,41	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	2.490,04	0,27	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	1.249,32	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber	-	42,91	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-998,81	0,00	
			6.011.106,64		

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO					QT de Cotas	1517443
Renda Fixa						
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)	
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023	-	4.348.044,58	401,65	10,75%	
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	-	2.779.134,98	727,31	6,87%	
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	1.799.544,74	2.196,17	4,45%	
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050	-	1.627.798,79	355,90	4,02%	
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024	-	1.599.921,39	407,50	3,95%	
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022	-	1.383.644,14	363,31	3,42%	
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045	-	916.815,35	206,43	2,27%	
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	-	873.738,41	217,66	2,16%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	933.070,72	4,35	2,31%	
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055	-	840.910,44	184,50	2,08%	
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035	-	823.409,29	191,65	2,04%	
Operações Compromissadas	LFT_08072016_01092022	-	8.097.150,07	747,16	20,01%	
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030	-	774.549,50	186,00	1,91%	
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025	-	690.865,52	176,72	1,71%	
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	-	617.181,31	139,18	1,53%	
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	-	519.895,80	127,05	1,29%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	536.280,10	10,65	1,33%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	495.958,01	9,56	1,23%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	493.265,03	9,56	1,22%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	488.042,93	0,47	1,21%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO C6 SA	480.640,61	0,47	1,19%	
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	418.664,34	419,90	1,03%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	348.171,67	1,33	0,86%	
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	294.434,46	299,99	0,73%	
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022	-	273.273,64	25,13	0,68%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	288.073,47	5,58	0,71%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	272.668,75	5,41	0,67%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	264.331,76	5,26	0,65%	
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	242.882,29	244,45	0,60%	
Operações Compromissadas	NTNB_15012014_15052023	-	209.694,70	55,23	0,52%	
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022	-	213.891,42	19,67	0,53%	
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	198.422,08	39,53	0,49%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	187.320,97	0,45	0,46%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	183.556,16	0,39	0,45%	
Títulos Públicos	LFT_06072018_01092024	-	165.008,39	15,26	0,41%	
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	178.482,02	179,46	0,44%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	173.932,63	0,24	0,43%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	156.331,52	3,11	0,39%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	155.323,69	3,01	0,38%	
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	154.473,57	154,87	0,38%	
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial P	COMPANHIA DE TR	151.542,88	0,10	0,37%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	150.179,89	2,94	0,37%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	147.923,79	2,92	0,37%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	145.259,61	2,84	0,36%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	138.699,45	2,74	0,34%	
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial P	LOCALIZA	124.028,69	0,12	0,31%	
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	122.950,93	12,15	0,30%	
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU SA	110.692,44	112,32	0,27%	
Debênture simples	SSED	SABER SERVIÇOS	104.744,70	10,40	0,26%	
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	105.682,19	104,20	0,26%	
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	103.957,64	104,20	0,26%	
Debênture simples	CEPE18	CELPE	106.095,25	11,73	0,26%	
Debênture simples	EKTR19	ELEKTRO S/A	103.365,64	103,12	0,26%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	97.915,34	0,37	0,24%	
Debênture simples	Debêntures	REDE D'OR SAO L	97.053,22	96,96	0,24%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	97.022,87	1,90	0,24%	
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	95.732,22	1,88	0,24%	

Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	90.789,18	89,41	0,22%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	91.696,55	18,39	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	85.190,01	0,30	0,21%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	83.265,08	83.132,02	0,21%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	77.977,52	76,05	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	77.807,63	0,29	0,19%
Operações Compromissadas	NTNB_10022010_15082030	-	73.392,83	18,06	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	76.858,86	1,48	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	76.761,06	1,51	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	76.276,99	1,48	0,19%
Debênture simples	ELEK18	ELEKTRO S/A	73.725,66	73,36	0,18%
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021	-	67.863,50	6,23	0,17%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB	72.053,90	94,74	0,18%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	70.924,19	70,54	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	67.240,58	68,15	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	62.402,24	1,24	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	61.701,31	0,24	0,15%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	59.356,36	5,80	0,15%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	57.338,18	5,56	0,14%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	56.555,54	55,98	0,14%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	56.704,96	56,99	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	51.506,28	0,30	0,13%
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025	-	49.062,09	44,99	0,12%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	49.012,94	49,12	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	47.650,75	0,17	0,12%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	50.345,61	70,22	0,12%
Títulos Públicos	LFT_13012017_01032023	-	45.601,87	4,19	0,11%
Títulos Públicos	LFT_26102018_01032025	-	44.067,88	4,08	0,11%
Títulos Públicos	LFT_03072020_01032027	-	42.712,83	3,99	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	42.921,90	0,25	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	42.678,00	0,84	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	38.876,45	3,85	0,10%
Debênture simples	SBSPB3	SABESP	36.650,78	37,73	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	34.286,15	0,15	0,08%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	34.468,71	3,26	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	33.720,74	0,67	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	33.355,53	0,12	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	33.355,53	0,12	0,08%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES S	32.445,71	31,88	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RABOBANK	30.606,96	0,20	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	30.254,69	29,46	0,07%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	30.162,62	30,12	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	28.898,04	0,13	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A	27.824,11	27,04	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	27.839,96	0,17	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	27.688,88	26,77	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	27.573,54	0,15	0,07%
Debênture simples	SULM18	Sul América SA	27.294,54	26,92	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	26.723,71	26,35	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	26.877,60	0,52	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	26.303,80	0,12	0,07%
Debênture simples	CEEBO0	COELBA	24.445,18	2,45	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	24.011,10	23,71	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	23.986,52	0,05	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025	-	24.066,89	21,85	0,06%