

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			46.450,24	0,008%
Total do Disponível			46.450,24	0,008%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		16.180.122,67	2,77%
Total Operações com Participantes			16.180.122,67	2,77%
<u>Fundos</u>				
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.788.416,2218	522.545.528,08	89,31%
*Quimera FI RF	Cota de Fundo	5.021.869,1250	5.898.354,73	1,01%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	10.000,0000	1.112.450,55	0,19%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	1.517.442,8015	39.196.041,14	6,70%
Sub-total			568.752.374,50	97,21%
Total Renda Fixa			568.752.374,50	97,21%
Depósito Judiciais/Recursais			149.268,90	0,03%
Total Depósito Judicial/Recursal			149.268,90	0,03%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			13.392,20	0,00%
Total Exigível Operacional			13.392,20	0,00%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			33.161,51	0,01%
Total Exigível Contingencial			33.161,51	0,01%
Total Plano I			585.081.662,60	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas	2788416
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		130.480.467,02	30.527,93	24,97%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		123.544.551,42	29.459,77	23,64%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		81.166.113,85	9.278,82	15,53%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		65.209.242,83	15.146,73	12,48%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		30.147.529,92	7.815,86	5,77%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		28.190.694,79	6.940,08	5,39%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		21.415.719,83	26.324,40	4,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	12.448.477,15	16,03	2,38%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		9.381.109,61	2.225,51	1,80%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		7.382.837,56	1.452,95	1,41%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		5.178.743,84	1.316,67	0,99%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		5.139.450,31	1.282,60	0,98%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	2.207.369,71	3,01	0,42%
Valores a receber	Valores a Receber		673.251,48		0,13%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.446,00		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-29.477,22		-0,01%
TOTAL			522.545.528,08		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	1517443
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		340,68	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		288,98	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-21.935,36	0,00	-0,06%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		11.619.101,17	1.089,95	29,64%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		6.374.155,54	7.819,13	16,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	851.420,86	4,05	2,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	453.157,57	8,89	1,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	449.585,98	8,89	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	442.099,32	0,44	1,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	318.213,20	1,23	0,81%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participaçõ	647.919,49	63,12	1,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	261.429,77	5,19	0,67%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	244.000,26	1,14	0,62%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	366.571,85	36,74	0,94%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	169.816,44	0,42	0,43%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	275.265,15	27,43	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	165.250,08	0,36	0,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	156.095,67	0,22	0,40%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	140.930,53	2,80	0,36%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	136.916,19	2,73	0,35%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	219.022,39	227,18	0,56%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	126.052,73	126,02	0,32%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	219.619,54	223,39	0,56%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	344.468,68	349,25	0,88%
Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note					
Títulos de Crédito Privado	LOCALIZA		112.503,54	0,11	0,29%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	171.734,11	17,09	0,44%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	101.639,58	104,38	0,26%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	113.470,89	11,29	0,29%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	114.508,16	11,54	0,29%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		96.709,85	9,04	0,25%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	90.576,88	224,76	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	89.548,91	0,34	0,23%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	80.489,54	88,05	0,21%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	152.509,88	151,54	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	76.468,19	0,28	0,20%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	95.576,83	96,84	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	70.956,06	0,27	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	70.058,01	1,37	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	69.347,09	1,37	0,18%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		67.071,73	6,28	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	63.434,06	0,39	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	60.820,06	63,34	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	56.392,21	0,22	0,14%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	74.479,13	77.261,07	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	55.509,05	53,62	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	55.529,29	53,64	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	46.982,72	0,28	0,12%
Debênture simples	LAMEA2	LOJAS AMERICANA	68.738,87	6,89	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	44.422,17	0,16	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	44.045,19	0,27	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	42.795,37	0,19	0,11%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	93.260,08	96,84	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	39.229,09	0,17	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	39.152,27	0,23	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	37.218,42	0,17	0,09%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	80.760,79	8,06	0,21%

Debênture simples	SBSPB3	SABESP	34.161,77	35,07	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	31.327,84	0,14	0,08%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	113.467,43	118,13	0,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	31.095,52	0,11	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	31.095,52	0,11	0,08%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	101.524,80	10,90	0,26%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	52.077,17	52,97	0,13%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	30.295,86	30,40	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	28.530,24	0,12	0,07%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	27.636,76	27,99	0,07%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	53.893,72	65,26	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	25.423,86	0,16	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	25.171,76	0,14	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	24.411,27	0,48	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	23.962,86	0,11	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		23.522,10	20,31	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	23.025,58	0,14	0,06%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	22.576,11	2,28	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	21.954,21	0,09	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	21.595,63	0,05	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	21.132,69	22,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	20.843,17	0,12	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	18.728,01	0,08	0,05%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	35.550,92	3,58	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	18.447,59	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	18.295,17	0,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	18.237,89	17,77	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	18.237,77	17,77	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	17.166,47	0,06	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	16.322,05	0,08	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	14.160,78	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.326,65	0,05	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.744,70	0,05	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	12.683,46	0,08	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	12.188,29	1,23	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	11.444,31	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	8.884,43	0,03	0,02%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F22		8.226,97	45,20	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	7.080,39	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.248,23	0,02	0,01%
Operações Compromissadas	LFT_14072017_01092023		833,41	0,08	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22		27,88	0,14	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		-94,60	-0,25	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.842.270,84	427,92	4,70%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		1.643.071,92	440,21	4,19%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		1.104.728,65	286,40	2,82%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		1.071.981,30	250,81	2,73%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		1.049.655,80	273,60	2,68%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		968.746,22	231,00	2,47%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		783.993,01	217,68	2,00%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		643.650,04	163,35	1,64%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		620.233,81	140,31	1,58%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		618.677,64	146,77	1,58%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		561.684,47	138,28	1,43%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		505.526,22	128,53	1,29%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		290.629,84	72,53	0,74%
Total			39.196.041,14	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		2.415.721,99	225,36	40,96%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		1.221.028,98	1.500,90	20,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	430.896,57	2,04	7,31%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	262.908,40	1,26	4,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	247.624,56	4,88	4,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	176.773,04	3,46	3,00%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	175.248,39	3,46	2,97%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	154.853,55	0,94	2,63%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	142.699,78	2,83	2,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	130.816,21	0,63	2,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	83.791,51	0,16	1,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	76.118,94	0,47	1,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	71.499,47	1,42	1,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	42.765,97	0,16	0,73%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	41.866,22	0,16	0,71%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	41.055,20	0,16	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	33.960,79	0,16	0,58%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	33.504,08	0,16	0,57%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	32.704,05	0,16	0,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	32.114,49	0,63	0,54%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	24.651,42	0,16	0,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO, FI	24.295,47	0,16	0,41%
Disponibilidades	Disponibilidade		1.444,39	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber		601,55	0,00	0,01%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-590,31	0,00	-0,01%
Total			5.898.354,70		100,00%