

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			13.164,07	0,002%
Total do Disponível			13.164,07	0,002%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		15.920.997,40	2,68%
Total Operações com Participantes			15.920.997,40	2,68%
<u>Fundos</u>				
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.783.911,5857	531.906.406,26	89,48%
*Quimera FI RF	Cota de Fundo	5.021.869,1250	5.908.433,76	0,99%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	10.000,0000	1.121.698,15	0,19%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	1.517.442,8015	39.497.362,69	6,64%
Sub-total			578.433.900,86	97,30%
Total Renda Fixa			578.433.900,86	97,30%
Depósito Judiciais/Recurais			149.268,90	0,03%
Total Depósito Judicial/Recursal			149.268,90	0,03%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			19.827,77	0,00%
Total Exigível Operacional			19.827,77	0,00%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			33.456,64	0,01%
Total Exigível Contingencial			33.456,64	0,01%
Total Plano I			594.464.046,82	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas 2783912
Renda Fixa	

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		130.882.551,23	30.527,40	24,61%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		123.778.258,30	29.459,25	23,27%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		82.330.392,71	9.278,66	15,48%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		67.117.743,83	15.146,47	12,62%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		30.622.064,05	7.815,72	5,76%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		28.879.401,74	6.939,96	5,43%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		26.541.138,64	32.407,18	4,99%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	12.630.159,65	16,03	2,37%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		9.567.550,39	2.225,48	1,80%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		7.611.145,93	1.452,92	1,43%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		5.267.216,39	1.316,65	0,99%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		5.246.079,70	1.282,58	0,99%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	2.240.041,53	3,01	0,42%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.108,14		0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		4.456,62		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-820.902,94		-0,15%
TOTAL			531.906.405,91		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	1517443
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		544,02	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		14.500,01	0,00	0,04%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-27.532,24	0,00	-0,07%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		11.756.463,77	1.099,40	29,77%
Operações Compromissadas	NTNF_15012016_01012027		5.473.517,93	4.816,70	13,86%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	875.059,83	4,14	2,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	465.796,73	9,10	1,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	462.062,43	9,10	1,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	455.270,60	0,45	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO C6 S.A	449.453,49	0,45	1,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	327.410,25	1,26	0,83%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participaçõ	665.638,52	64,62	1,69%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	269.270,92	5,31	0,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	250.634,10	1,17	0,63%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	376.840,30	37,61	0,95%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	175.576,37	0,43	0,44%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	281.107,63	28,08	0,71%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	170.560,15	0,37	0,43%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	161.446,35	0,22	0,41%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	145.117,48	2,86	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	140.885,55	2,80	0,36%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	226.128,80	232,58	0,57%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	127.873,98	129,01	0,32%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	275.633,50	285,43	0,70%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	354.262,94	357,54	0,90%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial Pape	LOCALIZA	115.673,13	0,11	0,29%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	174.577,03	17,49	0,44%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	103.179,34	106,86	0,26%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	116.798,61	11,56	0,30%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		99.299,33	9,26	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	92.009,37	0,35	0,23%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	98.913,72	9,90	0,25%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	156.763,72	155,14	0,40%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	78.839,44	90,14	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	77.630,46	0,29	0,20%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	99.204,58	99,14	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	72.937,54	0,27	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	72.009,59	1,41	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	71.301,94	1,41	0,18%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		68.883,91	6,43	0,17%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	66.679,16	67,11	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	65.189,60	0,40	0,17%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	62.521,34	64,84	0,16%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	78.128,26	79.096,04	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	58.022,07	0,22	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	57.083,01	54,91	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	57.061,36	54,89	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	48.287,08	0,29	0,12%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	46.361,99	46,74	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	45.171,40	0,16	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	43.989,96	0,19	0,11%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	96.890,70	99,14	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	40.324,13	0,18	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	40.239,23	0,24	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	38.249,19	0,18	0,10%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	105.678,64	10,49	0,27%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	36.419,78	3,52	0,09%

Debênture simples	SBSPB3	SABESP	34.591,37	35,90	0,09%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	53.442,75	53,26	0,14%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	32.818,89	3,10	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	32.196,53	0,14	0,08%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	165.770,29	170,74	0,42%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	104.631,81	11,16	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	31.619,98	0,11	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	31.619,98	0,11	0,08%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	53.101,20	54,22	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	29.326,64	0,13	0,07%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	28.493,69	28,65	0,07%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	28.051,07	28,03	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	26.127,73	0,16	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	25.871,11	0,14	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	25.144,54	0,50	0,06%
Debênture simples	MOV115	MOVIDA PARTI	25.142,21	25,07	0,06%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	50.530,39	66,81	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	24.637,30	0,11	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		24.050,70	20,79	0,06%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	22.932,56	2,33	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	22.666,52	22,56	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	22.289,75	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	21.420,95	0,13	0,05%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	20.679,62	20,60	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	19.253,86	0,08	0,05%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	36.524,08	3,66	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	18.956,47	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	18.746,81	18,20	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	18.746,66	18,20	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	17.434,74	0,06	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	16.758,26	0,08	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	14.825,97	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	14.376,01	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.551,42	0,05	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.551,42	0,05	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	13.034,47	0,08	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.938,41	0,05	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	12.552,39	1,26	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	11.623,16	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	9.034,28	0,03	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	7.188,01	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.312,80	0,02	0,01%
Operações Compromissadas	LFT_14072017_01092023		1.876,82	0,18	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		48,88	0,26	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22		-4,31	-0,14	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F22		-1.742,48	-41,32	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.821.860,40	411,14	4,61%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		1.605.582,05	425,09	4,07%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		1.327.959,60	350,62	3,36%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		1.080.120,90	278,02	2,73%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		1.026.750,03	241,82	2,60%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		933.467,45	222,17	2,36%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		743.404,36	209,71	1,88%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		739.165,62	189,60	1,87%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		620.702,27	144,38	1,57%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		619.903,86	139,12	1,57%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		589.007,69	141,54	1,49%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		491.028,67	125,08	1,24%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		288.239,49	70,47	0,73%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		41.582,55	50,77	0,11%

Total	39.497.362,69	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		2.434.094,72	226,71	41,20%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		1.196.678,82	1.461,17	20,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	434.549,50	2,06	7,35%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	265.188,77	1,27	4,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	249.762,43	4,90	4,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	178.182,39	3,48	3,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	176.753,90	3,48	2,99%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	156.068,62	0,95	2,64%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	143.950,56	2,85	2,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	131.880,83	0,63	2,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	84.456,76	0,16	1,43%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	76.724,18	0,47	1,30%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	72.141,47	1,42	1,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	42.669,50	0,16	0,72%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	41.377,79	0,16	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	40.016,85	0,16	0,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	34.225,09	0,16	0,58%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	33.804,52	0,16	0,57%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	32.970,21	0,16	0,56%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	32.383,64	0,63	0,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	24.877,50	0,16	0,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO, FI	24.527,86	0,16	0,42%
Disponibilidades	Disponibilidade		1.477,51	0,00	0,03%
Valores a receber	Valores a Receber		321,28	0,00	0,01%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-650,93	0,00	-0,01%
Total			5.908.433,76		100,00%