

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			6.298,56	0,001%
Total do Disponível			6.298,56	0,001%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		15.461.068,52	2,49%
Total Operações com Participantes			15.461.068,52	2,49%
<u>Fundos</u>				
*Marbella - FI RF	Cota de Fundo	2.776.535,85231164	558.903.902,28	89,94%
*Quimera - FI RF	Cota de Fundo	5.021.869,12499887	5.922.955,36	0,95%
Vinci FI R Imobiliário CP LP	Cota de Fundo	10.000,00000000	1.007.319,23	0,16%
* Hermes FIC de FI MM	Cota de Fundo	1.517.442,80145405	40.197.278,21	6,47%
Sub-total			606.031.455,08	97,52%
Total Renda Fixa			606.031.455,08	97,52%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			14.788,71	0,00%
Total Exigível Operacional			14.788,71	0,00%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			33.774,47	0,01%
Total Exigível Contingencial			33.774,47	0,01%
Total Plano I			621.450.258,98	100,00%

*Fundo exclusivo

MARBELLA - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas 2776536
Renda Fixa	

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		140.819.659,33	30.466,00	25,20
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		132.882.637,46	29.400,00	23,78
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		81.075.496,81	9.260,00	14,51
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		72.738.144,34	15.116,00	13,01
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		31.341.805,89	7.800,00	5,61
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		30.422.213,46	6.926,00	5,44
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		25.024.655,94	29.581,00	4,48
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	12.786.223,93	16,00	2,29
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		10.302.248,80	2.221,00	1,84
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		7.547.129,87	1.450,00	1,35
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		5.489.803,47	1.280,00	0,98
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		5.466.950,74	1.314,00	0,98
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	2.268.279,27	3,00	0,41
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB.	1.083.028,42	2.000,00	0,19
Disponibilidades	Disponibilidade		9.690,94		0,00
Valores a receber	Valores a Receber		673,26		0,00
Valores a pagar	Valores a Pagar		-354.738,02		-0,06
Total			558.903.903,91		100,00

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	1517443
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		426,59	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		49,69	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-6.894,15	0,00	-0,02%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		12.597.164,90	1.174,11	31,34%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		4.492.586,62	1.174,94	11,18%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		1.868.785,59	2.209,04	4,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	937.440,97	4,42	2,33%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	498.528,84	9,72	1,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	495.277,33	9,72	1,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	487.748,53	0,48	1,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO C6 S.A	481.309,41	0,48	1,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	350.370,47	1,35	0,87%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	288.168,11	5,67	0,72%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	268.147,65	1,25	0,67%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	403.526,94	40,17	1,00%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	188.155,26	0,46	0,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	182.960,14	0,39	0,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	173.380,69	0,24	0,43%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	155.150,70	3,06	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	150.191,66	2,99	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	144.534,12	2,89	0,36%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	240.803,01	248,39	0,60%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	156.448,26	157,36	0,39%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	295.436,19	304,83	0,73%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	380.318,37	381,84	0,95%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória	LOCALIZA	124.005,33	0,12	0,31%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	186.848,66	18,68	0,46%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	111.112,64	114,13	0,28%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	125.154,00	12,35	0,31%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		106.255,51	9,89	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	98.471,22	0,38	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	96.904,66	1,93	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	95.661,62	1,91	0,24%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	91.183,27	90,85	0,23%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	105.960,74	10,57	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	84.652,02	0,31	0,21%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	82.263,63	96,26	0,20%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	106.228,33	105,88	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	78.170,99	0,29	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	77.122,90	1,50	0,19%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	77.325,29	77,27	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	76.489,41	1,50	0,19%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		73.725,09	6,86	0,18%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	71.498,97	71,67	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	69.761,77	0,43	0,17%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	67.134,56	69,25	0,17%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	83.696,20	84.471,40	0,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	62.090,97	0,24	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	61.085,71	58,64	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	61.062,69	58,63	0,15%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	60.102,11	5,89	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	51.746,87	0,31	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	49.633,14	49,92	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	49.019,38	0,17	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	47.080,48	0,20	0,12%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	103.902,31	105,88	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	43.157,10	0,19	0,11%

Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	43.122,39	0,26	0,11%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	113.201,52	11,20	0,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	40.932,28	0,19	0,10%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	39.026,43	3,76	0,10%
Debênture simples	SBSBP3	SABESP	37.079,38	38,34	0,09%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	57.267,65	56,88	0,14%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	178.437,81	182,35	0,44%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	34.324,25	3,31	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	34.464,27	0,15	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	34.313,57	0,12	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	34.313,57	0,12	0,09%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	112.501,46	11,92	0,28%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	57.050,55	57,91	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	31.386,99	0,14	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	30.560,94	30,60	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	30.075,28	29,94	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	28.864,82	0,14	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A.	28.054,00	27,48	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	27.977,65	0,17	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	27.714,70	0,15	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	27.217,50	27,20	0,07%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		26.756,31	22,20	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	26.953,07	26,78	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	26.874,49	0,53	0,07%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	54.140,14	71,35	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	26.392,04	0,12	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	24.616,79	2,49	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	24.253,72	24,10	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	23.909,74	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	22.930,59	0,14	0,06%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	22.153,98	22,00	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	20.615,83	0,09	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	20.300,74	0,03	0,05%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	38.729,45	3,91	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	18.988,28	0,07	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	18.354,80	18,34	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	18.040,51	0,09	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	16.097,39	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	15.676,30	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	14.705,82	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	14.705,82	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	14.108,67	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	13.948,66	0,09	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	13.309,74	1,35	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.658,85	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	9.803,88	0,03	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	7.838,15	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.702,89	0,02	0,01%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F23		1.682,81	21,31	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22		4,37	0,15	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		-28,05	-0,27	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.874.588,60	389,57	4,66%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		1.614.887,01	418,06	4,02%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		1.047.082,02	226,53	2,60%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		1.041.758,44	259,26	2,59%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		945.757,76	209,25	2,35%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		778.801,87	192,73	1,94%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		716.206,90	202,04	1,78%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		654.061,22	134,38	1,63%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		625.174,85	142,33	1,56%

Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	620.481,43	133,77	1,54%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	483.604,25	116,24	1,20%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	285.237,66	66,51	0,71%
Total		40.197.278,21		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		2.257.054,51	209,89	38,11%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		1.033.791,60	1.222,02	17,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	403.580,83	1,90	6,81%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	246.345,36	1,17	4,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	231.749,62	4,54	3,91%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	165.326,97	3,22	2,79%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	164.248,68	3,22	2,77%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	133.339,31	2,64	2,25%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	125.514,21	12,30	2,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	122.320,54	0,59	2,07%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	80.175,78	7,91	1,35%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	78.371,25	0,15	1,32%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	71.185,07	0,44	1,20%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	112.084,80	114,54	1,89%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	66.926,55	1,32	1,13%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	65.018,05	67,08	1,10%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	45.911,02	4,69	0,78%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	61.856,36	62,10	1,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	40.337,39	0,15	0,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	38.391,02	0,15	0,65%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	57.390,87	5,71	0,97%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	38.221,70	0,15	0,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	31.748,80	0,15	0,54%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	31.421,20	0,15	0,53%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	30.580,13	0,15	0,52%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	30.067,94	0,59	0,51%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	27.119,63	35,74	0,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	23.212,08	0,15	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO, FI	22.843,02	0,15	0,39%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	18.809,96	1,90	0,32%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS RENT A C	13.320,91	1,32	0,22%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	16.614,11	17,14	0,28%
Debênture simples	LCAMA9	COMPANHIA DE LO	11.577,17	11,57	0,20%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	8.946,20	9,23	0,15%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	9.812,60	9,96	0,17%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	4.351,81	0,44	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	2.764,88	0,29	0,05%
Disponibilidades	Disponibilidade		1.406,65	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber		44,96	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-828,20	0,00	-0,01%
Total			5.922.955,36		100,00%