

jan/21

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>				
			159.017,92	0,026%
Total do Disponível			159.017,92	0,026%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		4.969.344,08	0,80%
Total Operações com Participantes			4.969.344,08	0,80%
<u>Fundos</u>				
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	146.582.870	565.719.431,16	90,89%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.342.596	35.505.203,55	5,70%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	11.981.567	14.153.164,83	2,27%
Vinci FI RF Imobiliário CP LP	Cotas de Fundos	20.000	1.982.129,26	0,32%
Sub-total			617.359.928,80	99,18%
Total Renda Fixa			617.359.928,80	99,18%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			5.491,60	0,001%
Total Exigível Operacional			5.491,60	0,001%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			33.695,39	0,01%
Total Exigível Contingencial			33.695,39	0,01%
Total Plano III			622.449.103,81	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA III - FI RENDA FIXA	QT de Cotas	146582870
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		50.729.545,00	14.579,00	8,97%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		47.944.758,76	13.664,00	8,48%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		18.825.317,20	22.631,00	3,33%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		16.290.297,72	3.942,00	2,88%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		16.246.401,71	3.842,00	2,87%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		11.571.204,17	3.196,00	2,05%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		112.166.765,02	27.727,00	19,83%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		108.889.116,75	33.501,00	19,25%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		76.316.347,74	23.019,00	13,49%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		67.377.755,58	22.654,00	11,91%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		9.491.080,82	1.800,00	1,68%
Debênture simples	TAE33	TRANSMISSORA AL	7.997.235,02	5.000,00	1,41%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		7.317.421,18	1.140,00	1,29%
		ISEC			
		SECURITIZADORA			
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	S.A.	5.647.743,54	1.649,00	1,00%
Depósitos a prazo e outros títul Letra Financeira			4.562.133,65	6,00	0,81%
Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública	CETIP_08J0015454	ITAU UNIBANCO S	3.175.284,15	40,00	0,56%
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB.	1.632.529,40	3.000,00	0,29%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.775,86		0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		8.309,86		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-479.591,97		-0,08%
Total			565.719.431,16		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO
QT de Cotas 1342596
Renda Fixa

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	1.681.543,82	1.988,50	4,74%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050	-	1.597.023,04	339,38	4,50%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	-	1.465.011,72	379,11	4,13%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023	-	11.153.385,04	1.039,55	31,41%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024	-	913.598,47	227,70	2,57%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045	-	904.788,78	198,85	2,55%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	829.999,46	3,92	2,34%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035	-	823.114,76	183,81	2,32%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022	-	3.971.651,47	1.037,63	11,19%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025	-	680.793,57	169,25	1,92%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021	-	620.567,44	173,72	1,75%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055	-	559.338,53	118,73	1,58%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030	-	552.192,35	127,51	1,56%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	-	551.146,41	120,15	1,55%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	-	452.531,84	109,51	1,27%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SANT BANESPA	441.391,71	8,60	1,24%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SANT BANESPA	438.512,86	8,60	1,24%
Depósitos a prazo e outros título	DPGE	BANCO CNH	431.846,94	0,42	1,22%
Depósitos a prazo e outros título	DPGE	BANCO C6 SA	426.145,82	0,42	1,20%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	357.278,12	35,56	1,01%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	336.729,51	338,08	0,95%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	310.213,98	1,19	0,87%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	261.575,81	269,89	0,74%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	255.140,74	5,02	0,72%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	-	244.796,49	57,89	0,69%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	237.414,84	1,10	0,67%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	213.204,22	219,92	0,60%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	166.590,50	0,41	0,47%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	165.433,65	16,54	0,47%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	161.990,81	0,35	0,46%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	157.986,78	161,45	0,44%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	153.509,27	0,21	0,43%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	138.517,49	139,33	0,39%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	137.368,65	2,71	0,39%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SAFRA S/A	132.977,97	2,65	0,37%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	Banco Daycoval	127.968,85	2,56	0,36%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	110.809,92	10,93	0,31%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial Paper/ Expo	LOCALIZA	109.792,90	0,11	0,31%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	100.227,33	9,92	0,28%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU SA	98.377,85	101,05	0,28%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	99.607,50	10,55	0,28%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022	-	94.077,41	8,75	0,26%
Debênture simples	SSED	SABER SERVIÇOS	93.816,42	9,36	0,26%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	94.053,34	93,74	0,26%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	91.993,91	93,74	0,26%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	87.185,29	0,33	0,25%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	85.798,27	1,71	0,24%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SAFRA S/A	84.697,70	1,69	0,24%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	80.732,62	80,44	0,23%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	74.949,93	0,27	0,21%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB	72.835,27	85,23	0,21%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	74.103,65	74.790,01	0,21%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	69.211,70	0,26	0,19%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participação	68.462,92	68,42	0,19%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	68.283,73	1,33	0,19%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	67.722,84	1,33	0,19%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022	-	65.275,35	6,08	0,18%

Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	63.304,37	63,46	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	61.766,27	0,38	0,17%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	59.440,17	61,31	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	54.974,63	0,21	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	54.064,21	51,91	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	54.084,59	51,92	0,15%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	53.213,72	5,22	0,15%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	50.704,12	50,36	0,14%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	50.511,91	51,27	0,14%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	47.935,06	63,17	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	45.816,09	0,27	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	43.944,61	44,20	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	43.401,20	0,15	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	41.684,51	0,18	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	38.210,80	0,17	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	38.180,07	0,23	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	36.240,97	0,17	0,10%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	34.553,55	3,33	0,10%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	34.290,61	3,46	0,10%
Debênture simples	SBSBP3	SABESP	32.829,65	33,94	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	30.514,27	0,14	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	30.380,84	0,11	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	30.380,84	0,11	0,09%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	30.390,29	2,93	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	27.789,68	0,12	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	27.058,31	27,09	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	26.628,31	26,50	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	25.556,58	0,12	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A	24.838,69	24,33	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SAFRA S/A	24.771,09	0,15	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	24.538,28	0,14	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	24.098,06	24,09	0,07%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025	-	23.689,73	19,66	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	23.863,94	23,71	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	23.794,36	0,47	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	23.367,21	0,11	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	21.795,42	2,21	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	21.473,97	21,33	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	21.169,41	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	20.302,48	0,12	0,06%
Debênture simples	SEDU	Somos Educação	19.614,88	19,47	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	18.253,02	0,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	17.974,04	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	16.812,01	0,06	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	16.251,13	16,24	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	15.972,86	0,08	0,04%
Operações Compromissadas	NTNB_06012016_15052021	-	18.985,34	5,31	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	14.252,45	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	13.879,62	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.020,36	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.020,36	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.491,65	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	12.349,98	0,08	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	11.784,29	1,19	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	11.208,00	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	8.680,24	0,03	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	6.939,81	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.163,88	0,02	0,01%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	349,00	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber	-	268,28	0,00	0,00%

Mercado Futuro - Posições com FUTDI1F23	-	1.489,94	18,87	0,00%
Mercado Futuro - Posições com FUTDI1J22	-	3,87	0,14	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven FUTDI1F25	-	-24,83	-0,24	0,00%
Valores a pagar Valores a Pagar	-	-33.386,99	0,00	-0,09%
TOTAL	-	35.505.203,55	0,00	100,00%

QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

QT de Cotas 11981567

Renda Fixa

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	607.122,67	2,88	4,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	571.862,07	11,17	4,04%
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021	-	5.563.118,89	516,54	39,31%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	3.130.956,71	3.763,90	22,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	407.916,93	7,93	2,88%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	404.890,76	7,93	2,86%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	329.123,40	6,49	2,33%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	310.377,00	30,28	2,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	301.697,62	1,44	2,13%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	273.328,18	281,88	1,93%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	197.844,00	19,46	1,40%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	193.170,48	0,36	1,36%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	175.520,16	1,08	1,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	165.205,58	3,24	1,17%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	161.458,87	165,09	1,14%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	152.507,38	152,83	1,08%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	141.492,76	14,06	1,00%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	112.782,58	11,53	0,80%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	98.666,37	0,36	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	94.634,38	0,36	0,67%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	93.095,85	0,36	0,66%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	78.268,41	0,36	0,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	77.480,84	0,36	0,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	75.424,40	0,36	0,53%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	74.105,31	1,44	0,52%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	67.193,95	87,95	0,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	57.083,44	0,36	0,40%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO. FI	56.274,52	0,36	0,40%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	46.308,18	4,69	0,33%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	40.984,23	42,17	0,29%
Debênture simples	LCAMA9	COMPANHIA DE LO	28.586,96	28,48	0,20%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	24.161,82	24,51	0,17%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	21.834,99	22,71	0,15%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	10.725,99	1,08	0,08%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	6.818,21	0,72	0,05%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	3.430,22	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber	-	947,66	0,00	0,01%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-3.236,93	0,00	-0,02%
Total			14.153.164,83		100,00%