

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			21.578,53	0,003%
<u>Total do Disponível</u>			21.578,53	0,003%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		5.009.152,79	0,80%
<u>Total Operações com Participantes</u>			5.009.152,79	0,80%
<u>Fundos</u>				
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	146.285.044,46459900	560.054.987,31	89,85%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.342.596,22148152	35.565.567,14	5,71%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	11.981.566,53391740	14.131.448,24	2,27%
Vinci FI RF Imobiliário CP LP	Cotas de Fundos	20.000,00000000	2.014.638,46	0,32%
Sub-total			611.766.641,15	98,15%
<u>Total Renda Fixa</u>			611.766.641,15	98,15%
<u>Estruturados</u>				
<u>FIP's</u>				
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	4.792,66392001	5.512.882,91	0,88%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	49,99999988	1.055.409,70	0,17%
Sub-total			6.568.292,61	1,05%
<u>Total Estruturados</u>			6.568.292,61	1,05%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			25.528,42	0,00%
<u>Total Exigível Operacional</u>			25.528,42	0,00%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			33.210,51	0,01%
<u>Total Exigível Contingencial</u>			33.210,51	0,01%
Total Plano III			623.306.926,15	100,00%

MARBELLA III - FI RENDA FIXA	QT de Cotas	146285045
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		107.417.013,22	33.501,00	19,18
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		75.192.109,15	23.019,00	13,43
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		66.406.823,61	22.654,00	11,86
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		112.753.147,93	27.727,00	20,13
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		50.055.680,42	14.579,00	8,94
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		47.314.199,75	13.664,00	8,45
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		16.477.988,24	3.842,00	2,94
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		16.400.852,23	3.942,00	2,93
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		13.999.121,28	16.548,00	2,50
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		11.433.385,27	3.196,00	2,04
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		9.183.684,21	1.800,00	1,64
Debênture simples	TAE33	TRANSMISSORA AL	7.898.019,82	5.000,00	1,41
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		7.431.242,73	1.140,00	1,33
Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública	CRI / ISEC /120109/120122/087694510 00108	ISEC SECURITIZADORA S.A.	6.448.965,73	40,00	1,15
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		5.569.750,69	1.649,00	1,00
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	4.536.558,54	6,00	0,81
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB.	1.612.763,98	3.000,00	0,29
Disponibilidades	Disponibilidade		9.826,63		0,00
Valores a receber	Valores a Receber		673,26		0,00
Valores a pagar	Valores a Pagar		-86.817,82		-0,02
Total			560.054.988,87		100,00

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO	QT de Cotas 1342596
Renda Fixa	

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		377,44	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		43,97	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-6.099,78	0,00	-0,02%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		11.145.662,94	1.038,83	31,34%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		3.974.930,59	1.039,56	11,18%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		1.653.455,72	1.954,51	4,65%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	829.424,80	3,91	2,33%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		SANT BANESPA	441.086,11	8,60	1,24%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		SANT BANESPA	438.209,25	8,60	1,23%
Depósitos a prazo e outros títulos DPGE		BANCO CNH	431.547,95	0,42	1,21%
Depósitos a prazo e outros títulos DPGE		BANCO C6 S.A	425.850,77	0,42	1,20%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO ITAU S/A	309.999,21	1,19	0,87%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BCO VOTORANTIM	254.964,09	5,02	0,72%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	237.250,47	1,10	0,67%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	357.030,76	35,54	1,00%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	166.475,16	0,41	0,47%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	161.878,65	0,35	0,46%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	153.402,99	0,21	0,43%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BCO ALFA DE INV	137.273,54	2,70	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		SAFRA S/A	132.885,91	2,64	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		Banco Daycoval	127.880,25	2,55	0,36%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	213.056,60	219,77	0,60%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	138.421,59	139,23	0,39%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	261.394,71	269,70	0,73%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	336.496,37	337,84	0,95%
Títulos de Crédito Privado	ta Promissória/ Commercial Paper/ Export N	LOCALIZA	109.716,88	0,11	0,31%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	165.319,11	16,53	0,46%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	98.309,74	100,98	0,28%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	110.733,20	10,92	0,31%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		94.012,27	8,75	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO ITAU S/A	87.124,92	0,33	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BCO VOTORANTIM	85.738,87	1,71	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		SAFRA S/A	84.639,06	1,69	0,24%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	80.676,72	80,38	0,23%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	93.751,46	9,35	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	74.898,04	0,27	0,21%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	72.784,84	85,17	0,20%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	93.988,22	93,68	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BCO ALFA DE INV	69.163,78	0,26	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO CITIBANK	68.236,45	1,33	0,19%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	68.415,52	68,37	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BCO ALFA DE INV	67.675,96	1,33	0,19%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		65.230,16	6,07	0,18%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	63.260,54	63,41	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BC FIDIS INVEST	61.723,50	0,38	0,17%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	59.399,01	61,27	0,17%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	74.052,35	74.738,23	0,21%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO ITAU S/A	54.936,57	0,21	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos CDB/ RDB		BANCO GMAC S/A	54.047,14	51,89	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos CDB/ RDB		BANCO GMAC S/A	54.026,77	51,87	0,15%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	53.176,87	5,21	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	45.784,36	0,27	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	43.914,18	44,16	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	43.371,15	0,15	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		PARANA BANCO SA	41.655,65	0,18	0,12%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	91.930,22	93,68	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		PARANA BANCO SA	38.184,35	0,17	0,11%

Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	38.153,64	0,23	0,11%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	100.157,93	9,91	0,28%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		PARANA BANCO SA	36.215,88	0,17	0,10%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	34.529,63	3,32	0,10%
Debênture simples	SBSPB3	SABESP	32.806,92	33,92	0,09%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	50.669,01	50,33	0,14%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	157.877,40	161,34	0,44%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	30.369,25	2,93	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO ABC S/A	30.493,14	0,14	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	30.359,81	0,11	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	30.359,81	0,11	0,09%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	99.538,53	10,55	0,28%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	50.476,93	51,24	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		PARANA BANCO SA	27.770,44	0,12	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPOL MET	27.039,57	27,08	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	26.609,87	26,49	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		Banco Daycoval	25.538,88	0,12	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A.	24.821,49	24,31	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		SAFRA S/A	24.753,94	0,15	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO ABC S/A	24.521,29	0,14	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	24.081,37	24,07	0,07%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		23.673,33	19,64	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	23.847,42	23,69	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BCO VOTORANTIM	23.777,89	0,47	0,07%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	47.901,87	63,13	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		Banco Daycoval	23.351,03	0,11	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	21.780,33	2,21	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	21.459,10	21,32	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	21.154,75	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO ABC S/A	20.288,42	0,12	0,06%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	19.601,30	19,46	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		Banco Daycoval	18.240,38	0,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	17.961,60	0,03	0,05%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	34.266,87	3,46	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	16.800,37	0,06	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	16.239,87	16,23	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		Banco Daycoval	15.961,80	0,08	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	14.242,58	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	13.870,01	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	13.011,35	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	13.011,35	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	12.483,01	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BC FIDIS INVEST	12.341,43	0,08	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	11.776,13	1,19	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	11.200,24	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	8.674,23	0,03	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	6.935,00	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	4.161,00	0,02	0,01%
Mercado Futuro - Posições com FUTDI1F23			1.488,91	18,86	0,00%
Mercado Futuro - Posições com FUTDI1J22			3,87	0,14	0,00%
Mercado Futuro - Posições com FUTDI1F25			-24,82	-0,24	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.658.590,07	344,68	4,66%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		1.428.812,47	369,89	4,02%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		926.432,53	200,43	2,60%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		921.722,35	229,39	2,59%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		836.783,30	185,14	2,35%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		689.064,82	170,52	1,94%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		633.682,32	178,76	1,78%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		578.697,35	118,90	1,63%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		553.139,39	125,93	1,56%

Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	548.986,77	118,35	1,54%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	427.881,19	102,84	1,20%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	252.371,29	58,84	0,71%
Total		35.565.567,14		100,00%

QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

QT de Cotas 11981567

Renda Fixa

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021		5.385.056,49	500,78	38,11%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		2.466.500,55	2.915,59	17,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	962.894,59	4,54	6,81%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	587.749,96	2,80	4,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	552.926,30	10,83	3,91%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	394.449,98	7,69	2,79%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	391.877,29	7,69	2,77%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	318.131,31	6,29	2,25%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	299.461,59	29,36	2,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	291.841,86	1,40	2,07%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	191.289,63	18,87	1,35%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	186.984,23	0,35	1,32%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	169.838,88	1,05	1,20%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	267.420,65	273,28	1,89%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	159.678,58	3,15	1,13%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	155.125,14	160,05	1,10%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	109.538,09	11,18	0,78%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	147.581,72	148,17	1,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	96.240,10	0,35	0,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	91.596,28	0,35	0,65%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	136.927,62	13,63	0,97%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	91.192,31	0,35	0,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	75.748,77	0,35	0,54%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	74.967,14	0,35	0,53%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	72.960,46	0,35	0,52%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	71.738,43	1,40	0,51%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	64.704,13	85,27	0,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	55.381,19	0,35	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO, FI	54.500,66	0,35	0,39%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	44.878,26	4,54	0,32%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS RENT A C	31.782,07	3,15	0,22%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	39.639,23	40,89	0,28%
Debênture simples	LCAMA9	COMPANHIA DE LO	27.621,72	27,61	0,20%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	21.344,55	22,02	0,15%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	23.411,66	23,76	0,17%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	10.382,89	1,05	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	6.596,66	0,70	0,05%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.356,08	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber		107,28	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-1.975,98	0,00	-0,01%
Total			14.131.448,36		100,00%