

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			157.706,58	0,03%
<u>Total do Disponível</u>			157.706,58	0,03%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		4.959.870,60	0,80%
<u>Total Operações com Participantes</u>			4.959.870,60	0,80%
<u>Fundos</u>				
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	145.929.931	565.885.041,57	90,92%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.342.596	35.338.430,64	5,68%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	11.981.567	14.175.118,43	2,28%
Vinci FI RF Imobiliário CP LP	Cotas de Fundos	20.000	1.915.020,28	0,31%
<u>Sub-total</u>			617.313.610,92	99,19%
<u>Total Renda Fixa</u>			617.313.610,92	99,19%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			19.348,57	0,003%
<u>Total Exigível Operacional</u>			19.348,57	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			33.786,37	0,01%
<u>Total Exigível Contingencial</u>			33.786,37	0,01%
<u>Total Plano III</u>			622.378.053,16	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA III - FI RENDA FIXA	QT de Cotas	145929931
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		49.641.685,99	14.579,00	8,77%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		46.922.634,17	13.664,00	8,29%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		21.116.589,12	25.709,00	3,73%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		18.554.844,25	4.690,00	3,28%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		15.515.937,87	3.842,00	2,74%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		11.321.904,68	3.196,00	2,00%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		109.785.304,59	33.501,00	19,40%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		108.362.844,69	27.727,00	19,15%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		77.629.648,60	23.787,00	13,72%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		67.987.556,61	22.654,00	12,01%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		9.802.850,99	1.800,00	1,73%
Debênture simples	TAAE33	TRANSMISSORA AL	8.054.873,76	5.000,00	1,42%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		7.545.358,93	1.140,00	1,33%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		5.695.733,63	1.649,00	1,01%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		ITAU UNIBANCO S	4.561.656,97	6,00	0,81%
Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública	CRI /ISEC /120109/120121	ISEC SECURITIZADOR	3.264.372,30	40,00	0,58%
Valores a receber	Valores a Receber		137.132,88		0,02%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.487,88		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-25.374,22		0,00%
Total			565.885.041,57		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	1342596
Renda Fixa					

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Operações Compromissadas	NTNB_15012014_15052023	-	3.033.523,31	792,66	8,58%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	-	2.185.453,35	596,63	6,18%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050	-	1.493.520,66	357,63	4,23%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022	-	1.276.221,90	368,19	3,61%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	7.593.875,53	9.245,38	21,49%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024	-	889.423,22	230,71	2,52%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045	-	866.212,54	208,98	2,45%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	827.171,12	3,89	2,34%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035	-	781.030,42	192,93	2,21%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023	-	3.838.625,86	357,01	10,86%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025	-	654.229,10	177,39	1,85%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021	-	621.343,29	187,42	1,76%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055	-	554.202,75	120,63	1,57%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030	-	532.965,15	129,12	1,51%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	-	506.235,62	123,49	1,43%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SANT BANESPA	440.520,98	8,55	1,25%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SANT BANESPA	437.116,72	8,55	1,24%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	-	438.378,85	110,81	1,24%
Depósitos a prazo e outros título	DPGE	BANCO CNH	431.610,23	0,42	1,22%
Depósitos a prazo e outros título	DPGE	BANCO C6 SA	425.595,97	0,42	1,20%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	332.225,51	336,06	0,94%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	309.365,64	1,19	0,88%
Valores a receber	Valores a Receber	-	288.820,00	0,00	0,82%
Operações Compromissadas	NTNB_15102003_15082024	-	274.480,21	68,50	0,78%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	264.102,28	268,27	0,75%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	254.847,36	4,99	0,72%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	241.972,14	4,84	0,68%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	236.717,39	1,10	0,67%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	-	237.153,61	58,72	0,67%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	212.848,01	218,60	0,60%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	175.940,56	35,35	0,50%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	166.396,06	0,41	0,47%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	165.105,85	16,44	0,47%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	161.560,43	0,35	0,46%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	156.282,08	160,48	0,44%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	152.570,17	0,21	0,43%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	137.228,46	2,69	0,39%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	138.598,37	138,50	0,39%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SAFRA S/A	132.907,64	2,63	0,38%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	Banco Daycoval	128.029,05	2,54	0,36%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SAFRA S/A	122.647,18	2,45	0,35%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial Paper/ Expo	LOCALIZA	109.629,56	0,11	0,31%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	110.866,70	10,87	0,31%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU SA	97.490,45	100,44	0,28%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022	-	93.774,45	8,70	0,27%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	93.918,66	93,18	0,27%
Debênture simples	SSED	SABER SERVIÇOS	92.608,03	9,30	0,26%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	93.085,93	93,18	0,26%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	93.053,18	10,49	0,26%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	86.932,94	0,33	0,25%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	85.725,70	1,70	0,24%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SAFRA S/A	84.657,03	1,68	0,24%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	80.872,53	79,96	0,23%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	73.416,20	0,27	0,21%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	74.072,14	74.342,42	0,21%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB	69.264,17	84,72	0,20%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	68.992,18	0,26	0,20%

Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	68.400,02	68,01	0,19%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	68.070,17	1,32	0,19%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	67.816,18	1,35	0,19%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	67.483,74	1,32	0,19%
Debênture simples	ELEK18	ELEKTRO S/A	66.450,10	65,60	0,19%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022	-	65.058,43	6,04	0,18%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	63.736,93	63,08	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	58.811,44	60,94	0,17%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	54.824,29	0,21	0,16%
Depósitos a prazo e outros títul	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	53.970,67	51,61	0,15%
Depósitos a prazo e outros títul	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	53.950,33	51,60	0,15%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	52.513,31	5,19	0,15%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	51.986,72	4,97	0,15%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	49.972,74	50,06	0,14%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	50.418,66	50,96	0,14%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	48.100,22	62,79	0,14%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	45.651,86	0,27	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	44.011,93	43,93	0,12%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	42.721,32	0,15	0,12%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	41.583,38	0,18	0,12%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	38.118,10	0,17	0,11%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	38.043,22	0,23	0,11%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	37.659,83	0,75	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	34.256,76	3,44	0,10%
Debênture simples	SBSPB3	SABESP	32.818,79	33,74	0,09%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	30.442,32	2,92	0,09%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	30.428,80	0,14	0,09%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	29.904,93	0,11	0,08%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	29.904,93	0,11	0,08%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES S	28.548,27	28,51	0,08%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	27.722,25	0,12	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	26.972,09	26,93	0,08%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO RABOBANK	27.065,60	0,18	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	26.665,33	26,35	0,08%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	Banco Daycoval	25.344,38	0,12	0,07%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	SAFRA S/A	24.704,40	0,15	0,07%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	24.461,48	0,14	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A	24.368,83	24,18	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	24.107,99	23,94	0,07%
Debênture simples	SULM18	Sul América SA	24.102,76	24,08	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	24.050,53	23,57	0,07%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	23.756,67	0,47	0,07%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	Banco Daycoval	23.311,35	0,11	0,07%
Debênture simples	CEEBO	COELBA	21.731,19	2,19	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025	-	21.508,70	19,54	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	21.442,21	21,21	0,06%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	21.114,30	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	20.246,41	0,12	0,06%
Debênture simples	SEDU	Somos Educação	19.612,40	19,36	0,06%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	18.864,32	0,38	0,05%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	Banco Daycoval	18.211,93	0,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	17.920,25	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	16.488,17	0,06	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	16.248,23	16,14	0,05%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	Banco Daycoval	15.840,24	0,08	0,04%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	14.015,92	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	13.595,59	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	12.816,40	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	12.816,40	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.236,03	0,05	0,03%

Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	11.763,11	1,19	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	10.992,11	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	8.544,26	0,03	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	7.029,61	0,02	0,02%

QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

QT de Cotas 11981567

Renda Fixa

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021	-	5.146.075,61	477,07	36,30%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	561.453,75	2,66	3,96%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	549.310,09	10,99	3,88%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	529.311,06	10,32	3,73%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	3.426.010,02	4.171,09	24,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	377.286,41	7,32	2,66%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	374.370,81	7,32	2,64%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	304.882,78	5,99	2,15%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	283.219,87	27,96	2,00%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	279.227,99	1,33	1,97%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	253.524,62	260,34	1,79%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	183.421,70	17,98	1,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	178.670,14	0,33	1,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	162.370,10	1,00	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	152.880,91	3,00	1,08%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	150.104,45	152,48	1,06%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	139.547,22	141,16	0,98%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	133.335,07	2,66	0,94%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	103.966,51	10,65	0,73%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	90.346,96	0,33	0,64%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	87.529,78	0,33	0,62%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	84.781,57	0,33	0,60%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	71.658,85	0,33	0,51%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	69.807,00	0,33	0,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	68.537,50	1,33	0,48%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	64.623,04	12,98	0,46%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	62.224,66	81,23	0,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	52.666,07	0,33	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO. FI	51.996,62	0,33	0,37%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	42.772,87	4,33	0,30%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	37.925,89	38,95	0,27%
Debênture simples	LCAMA9	COMPANHIA DE LO	26.482,95	26,30	0,19%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	22.395,80	22,64	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	20.239,77	20,97	0,14%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES	15.000,96	14,98	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	9.940,91	1,00	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	5.906,09	0,67	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	3.136,94	0,00	0,02%
Total			14.175.118,43		100,00%