

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			154.874,34	0,02%
<u>Total do Disponível</u>			154.874,34	0,02%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		4.915.922,81	0,78%
<u>Total Operações com Participantes</u>			4.915.922,81	0,78%
<u>Fundos</u>				
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	145.189.669	576.208.574,67	91,05%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.342.596	35.482.634,94	5,61%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	11.981.567	14.246.957,62	2,25%
Vinci FI RF Imobiliário CP LP	Cotas de Fundos	20.000	1.888.934,71	0,30%
<u>Sub-total</u>			627.827.101,94	99,21%
<u>Total Renda Fixa</u>			627.827.101,94	99,21%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			19.709,22	0,003%
<u>Total Exigível Operacional</u>			19.709,22	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			34.356,36	0,01%
<u>Total Exigível Contingencial</u>			34.356,36	0,01%
<u>Total Plano III</u>			632.843.833,51	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA III - FI RENDA FIXA	QT de Cotas	145189669
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		51.002.308,99	14.579,00	9%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		48.194.899,83	13.664,00	8%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		23.837.634,89	5.962,00	4%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		20.603.664,12	5.091,00	4%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		18.399.465,78	22.472,00	3%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		11.597.502,57	3.196,00	2%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		112.852.492,10	33.501,00	20%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		108.967.213,51	27.727,00	19%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		79.966.274,36	23.787,00	14%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		70.022.871,14	22.654,00	12%
Debênture simples	TAAE33	TRANSMISSORA AL	8.259.851,75	5.000,00	1%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		8.000.141,91	1.140,00	1%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		5.858.561,71	1.649,00	1%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	4.600.946,80	6,00	1%
Outros valores mobiliários regis	CRI /ISEC /120109/12012	ISEC SECURITIZADOR	3.484.571,63	40,00	1%
Valores a receber	Valores a Receber		579.979,27		0%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.008,84		0%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-28.814,53		0%
Total			576.208.574,67		100%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO	QT de Cotas	1342596
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Operações Compromissadas	NTNB_15102003_15082024	-	2.737.676,40	704,32	7,72%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	-	2.528.670,44	649,14	7,13%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050	-	1.438.277,56	325,30	4,05%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022	-	1.260.274,18	334,70	3,55%
Operações Compromissadas	LTN_08012021_01072024	-	7.286.683,34	9.321,48	20,54%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024	-	1.046.931,91	267,30	2,95%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045	-	837.285,46	188,87	2,36%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	805.884,31	3,77	2,27%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035	-	763.319,37	175,83	2,15%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023	-	3.733.045,14	345,86	10,52%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055	-	668.837,92	147,90	1,88%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025	-	647.537,84	161,53	1,82%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021	-	607.502,11	167,75	1,71%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030	-	581.292,09	141,77	1,64%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	-	521.611,93	119,75	1,47%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	-	520.482,39	130,18	1,47%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SANT BANESPA	462.919,78	9,23	1,30%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SANT BANESPA	428.326,73	8,28	1,21%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SANT BANESPA	426.019,76	8,28	1,20%
Depósitos a prazo e outros título	DPGE	BANCO CNH	421.075,03	0,41	1,19%
Depósitos a prazo e outros título	DPGE	BANCO C6 SA	414.858,71	0,41	1,17%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	-	372.136,90	91,95	1,05%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	361.279,19	363,78	1,02%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	300.642,99	1,15	0,85%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	257.988,70	259,90	0,73%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	248.574,63	4,83	0,70%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	235.369,36	4,69	0,66%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SANT BANESPA	228.167,42	4,56	0,64%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	209.411,36	211,77	0,59%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	171.384,20	34,25	0,48%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	161.609,18	0,39	0,46%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	157.994,92	0,34	0,45%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	153.974,38	155,47	0,43%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	149.350,02	0,20	0,42%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	134.968,96	2,69	0,38%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	133.969,33	2,61	0,38%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	135.218,43	134,17	0,38%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SAFRA S/A	129.570,61	2,55	0,37%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	127.565,04	2,53	0,36%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	Banco Daycoval	125.123,50	2,46	0,35%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SAFRA S/A	119.505,64	2,37	0,34%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial Paper/ Expo	LOCALIZA	107.050,74	0,10	0,30%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	106.192,94	10,53	0,30%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU SA	96.677,26	97,30	0,27%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022	-	91.270,59	8,43	0,26%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	91.218,55	90,27	0,26%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	91.469,08	10,16	0,26%
Debênture simples	SSED	SABER SERVIÇOS	90.391,72	9,01	0,25%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	89.448,10	90,27	0,25%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	84.585,79	0,32	0,24%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	83.686,06	1,65	0,24%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SAFRA S/A	82.554,08	1,63	0,23%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	80.175,20	77,46	0,23%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	79.145,19	15,93	0,22%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	72.152,56	0,26	0,20%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	71.954,84	72.020,73	0,20%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	67.215,46	65,88	0,19%

Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	67.196,86	0,25	0,19%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO CITIBANK	66.379,62	1,28	0,19%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	66.191,04	1,31	0,19%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	65.848,38	1,28	0,19%
Debênture simples ELEK18	ELEKTRO S/A	64.846,22	63,55	0,18%
Debênture simples CMGD17	CEMIG DISTRIB	64.027,14	82,07	0,18%
Títulos Públicos LFT_08072016_01092022	-	63.311,83	5,85	0,18%
Debênture simples LIGH	LIGHT SERVICOS	61.159,28	61,11	0,17%
Debênture simples CPGT16	COPEL GERAÇÃO	57.938,95	59,04	0,16%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	53.278,51	0,20	0,15%
Debênture simples BSA313	B3 SA	51.221,53	5,02	0,14%
Debênture simples LAMEA4	LOJAS AMERICANA	50.722,62	4,82	0,14%
Debênture simples TIET27	ENERGIA PAULIST	48.781,41	48,50	0,14%
Debênture simples LORTA2	LOCALIZA RENT A	49.457,97	49,37	0,14%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO BRADESCO	44.484,62	0,26	0,13%
Debênture simples CLOR11	Celeo Redes Tra	46.929,46	60,83	0,13%
Debênture simples CELP	EQUATORIAL PARA	42.290,21	42,56	0,12%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO BRADESCO	40.695,27	0,15	0,11%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	PARANA BANCO SA	40.482,25	0,17	0,11%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	PARANA BANCO SA	37.108,72	0,16	0,10%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO BRADESCO	37.070,52	0,22	0,10%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	36.729,88	0,73	0,10%
Debênture simples SBSPB3	SABESP	32.038,27	32,69	0,09%
Debênture simples LORTA1	LOCALIZA RENT A	33.536,18	3,33	0,09%
Operações Compromissadas LTN_03012020_01012024	-	32.042,74	39,13	0,09%
Debênture simples LAMEA5	LOJAS AMERICANA	29.748,13	2,82	0,08%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO ABC S/A	29.611,86	0,13	0,08%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO CITIBANK	29.181,64	0,58	0,08%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO BRADESCO	28.486,69	0,10	0,08%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO BRADESCO	28.486,69	0,10	0,08%
Debênture simples BRPRA6	BR PROPERTIES S	27.641,70	27,62	0,08%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	PARANA BANCO SA	26.988,16	0,12	0,08%
Debênture simples BCBF15	BCBF PART SA	26.621,25	25,52	0,08%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO RABOBANK	26.391,08	0,17	0,07%
Debênture simples ELPLA3	ELETROPAULO MET	26.037,05	26,09	0,07%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	Banco Daycoval	24.767,17	0,12	0,07%
Debênture simples ENGIA3	ENERGISA S/A	23.984,02	23,43	0,07%
Debênture simples LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	23.929,43	23,19	0,07%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	SAFRA S/A	24.043,44	0,15	0,07%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO ABC S/A	23.807,80	0,13	0,07%
Debênture simples SULM18	Sul América SA	23.504,56	23,33	0,07%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	23.180,79	0,45	0,07%
Debênture simples MOVI15	MOVIDA PARTI	23.053,88	22,83	0,06%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	Banco Daycoval	22.701,26	0,10	0,06%
Debênture simples CEEBB0	COELBA	21.119,41	2,13	0,06%
Debênture simples CBRDB6	CIA BRASILEIRA	20.707,47	20,54	0,06%
Títulos Públicos NTF_10012014_01012025	-	20.760,96	18,93	0,06%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO BRADESCO	20.647,70	0,04	0,06%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO ABC S/A	19.702,52	0,12	0,06%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO ABC S/A	18.399,89	0,36	0,05%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	Banco Daycoval	17.728,03	0,07	0,05%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO BRADESCO	17.446,73	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	16.194,70	0,06	0,05%
Debênture simples RDCO20	RODOVIAS DAS CO	15.858,26	15,64	0,04%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	Banco Daycoval	15.479,48	0,07	0,04%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.837,08	0,04	0,04%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	13.361,59	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO BRADESCO	12.208,58	0,04	0,03%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	BANCO BRADESCO	12.208,58	0,04	0,03%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.025,43	0,04	0,03%

Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	11.506,69	1,15	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	10.796,46	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	8.139,05	0,03	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	6.874,26	0,01	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	6.680,79	0,01	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.008,48	0,01	0,01%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	315,78	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber	-	465,12	0,00	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1V23	-	121,70	0,82	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1J23	-	99,74	0,58	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1N24	-	80,41	0,47	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1N22	-	56,34	1,19	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1F25	-	44,96	0,23	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1N23	-	38,07	0,25	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1J22	-	32,08	1,11	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1V22	-	22,06	0,29	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1F22	-	8,88	0,42	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1F26	-	5,96	0,04	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1V21	-	0,09	0,16	0,00%
Mercado Futuro - Posições con	FUTDI1F24	-	-801,45	-5,69	0,00%
Mercado Futuro - Posições con	FUTDI1F23	-	-1.507,50	-10,96	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-15.480,78	0,00	-0,04%
Total			35.482.634,94		

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	571.801,63	2,70	4,01%
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021	-	5.169.317,17	477,24	36,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	558.765,72	11,13	3,92%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	539.448,78	10,46	3,79%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	2.886.873,78	3.525,85	20,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	383.625,18	7,42	2,69%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	381.558,97	7,42	2,68%
Títulos Públicos	LFT_08032019_01092025	-	331.513,81	31,03	2,33%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	310.749,41	6,07	2,18%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	288.891,14	28,33	2,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	284.273,54	1,35	2,00%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	261.208,19	263,75	1,83%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	253.254,37	5,06	1,78%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	183.726,84	18,21	1,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	181.847,77	0,34	1,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	155.941,53	3,04	1,09%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	153.337,88	154,47	1,08%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	142.020,47	143,00	1,00%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	135.854,63	2,70	0,95%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	105.902,34	10,79	0,74%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	92.854,03	0,34	0,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	89.062,78	0,34	0,63%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	88.845,28	0,34	0,62%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	72.999,44	0,34	0,51%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	71.068,38	0,34	0,50%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	69.892,98	1,35	0,49%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	65.829,35	13,15	0,46%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	63.487,54	82,29	0,45%
Debênture simples	KLBNA2	KLABIN S/A	58.720,21	6,07	0,41%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	53.816,11	0,34	0,38%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO. FI	53.051,69	0,34	0,37%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	43.805,15	4,38	0,31%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	39.020,59	39,46	0,27%
Debênture simples	LCAMA9	COMPANHIA DE LO	27.489,40	26,64	0,19%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	22.974,12	22,93	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	20.851,72	21,25	0,15%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES	15.189,07	15,18	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	10.177,02	1,01	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	6.071,14	0,67	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	3.065,41	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber	-	1.020,51	0,00	0,01%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-2.247,44	0,00	
Total			14.246.957,62		