

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			57.787,26	0,01%
<u>Total do Disponível</u>			57.787,26	0,01%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		4.827.710,54	0,76%
<u>Total Operações com Participantes</u>			4.827.710,54	0,76%
<u>Fundos</u>				
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	144.563.676	580.055.530,66	91,10%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.342.596	35.679.837,22	5,60%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	11.981.567	14.293.852,75	2,24%
Vinci FI RF Imobiliário CP LP	Cotas de Fundos	20.000	1.894.429,52	0,30%
<u>Sub-total</u>			631.923.650,15	99,24%
<u>Total Renda Fixa</u>			631.923.650,15	99,24%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			19.487,11	0,003%
<u>Total Exigível Operacional</u>			19.487,11	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			34.486,91	0,01%
<u>Total Exigível Contingencial</u>			34.486,91	0,01%
<u>Total Plano III</u>			636.755.173,93	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA III - FI RENDA FIXA		QT de Cotas	144563676
Renda Fixa			

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		51.531.993,36	14.579,00	9%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		48.688.601,94	13.664,00	8%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		25.483.966,14	31.107,00	4%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		23.981.481,53	5.962,00	4%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		20.761.631,11	5.091,00	4%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		11.700.851,95	3.196,00	2%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		110.746.613,10	27.727,00	19%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		110.540.295,35	33.501,00	19%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		80.902.181,39	23.787,00	14%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		68.458.494,33	22.654,00	12%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		8.375.076,71	1.140,00	1%
Debênture simples	TAE33	TRANSMISSORA AL	8.337.849,98	5.000,00	1%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		5.749.783,74	1.649,00	1%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	4.640.593,04	6,00	1%
Valores a receber	Valores a Receber		176.125,04		0%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.273,29		0%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-29.281,34		0%
Total			580.055.530,66		100%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO	QT de Cotas 1342596
Renda Fixa	

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	-	2.565.243,95	671,98	7,19%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	1.493.362,65	1.822,87	4,19%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050	-	1.486.368,60	330,28	4,17%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022	-	1.266.540,25	337,56	3,55%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024	-	1.247.817,75	317,59	3,50%
Operações Compromissadas	LFT_08072016_01092022	-	7.444.745,26	686,96	20,87%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	857.891,20	4,00	2,40%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045	-	843.608,60	191,21	2,36%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035	-	751.628,33	177,74	2,11%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023	-	3.973.439,90	367,05	11,14%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055	-	689.690,55	153,99	1,93%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030	-	684.774,34	165,67	1,92%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	-	661.316,85	165,84	1,85%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025	-	640.571,30	164,83	1,80%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	-	553.824,67	125,71	1,55%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SANT BANESPA	493.070,86	9,80	1,38%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SANT BANESPA	455.997,60	8,79	1,28%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SANT BANESPA	453.521,61	8,79	1,27%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	-	453.003,46	111,08	1,27%
Depósitos a prazo e outros título	DPGE	BANCO CNH	448.720,26	0,43	1,26%
Depósitos a prazo e outros título	DPGE	BANCO C6 SA	441.914,36	0,43	1,24%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	384.931,66	386,07	1,08%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	320.118,73	1,22	0,90%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	270.711,24	275,82	0,76%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	264.862,77	5,13	0,74%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	250.699,24	4,98	0,70%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SANT BANESPA	243.033,98	4,84	0,68%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	223.312,74	224,75	0,63%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	182.434,78	36,34	0,51%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	172.228,12	0,42	0,48%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	168.766,64	0,36	0,47%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	164.101,34	165,00	0,46%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	159.918,50	0,22	0,45%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	143.735,56	2,86	0,40%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	142.808,92	2,77	0,40%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	142.027,30	142,39	0,40%
Valores a receber	Valores a Receber	-	138.947,56	0,00	0,39%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial Paper/ Expo	COMPANHIA DE TR	139.332,75	0,09	0,39%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SAFRA S/A	138.079,57	2,70	0,39%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	136.005,25	2,69	0,38%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	Banco Daycoval	133.555,73	2,61	0,37%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SAFRA S/A	127.524,14	2,52	0,36%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial Paper/ Expo	LOCALIZA	114.035,44	0,11	0,32%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	113.044,51	11,17	0,32%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU SA	101.773,72	103,27	0,29%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022	-	97.116,33	8,95	0,27%
Debênture simples	EKTR19	ELEKTRO S/A	95.037,24	94,81	0,27%
Debênture simples	SSED	SABER SERVIÇOS	96.305,20	9,56	0,27%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	97.167,15	95,80	0,27%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	95.581,55	95,80	0,27%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	97.546,93	10,79	0,27%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	90.026,09	0,34	0,25%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	89.205,53	1,75	0,25%
Debênture simples	Debêntures	REDE D'OR SAO L	89.233,44	89,14	0,25%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SAFRA S/A	88.018,87	1,73	0,25%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	84.308,37	16,90	0,24%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	83.474,10	82,21	0,23%

Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	78.326,06	0,28	0,22%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	76.556,23	76.433,89	0,21%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	71.694,71	69,92	0,20%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	71.538,50	0,26	0,20%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	70.666,17	1,36	0,20%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	70.576,26	1,39	0,20%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	70.131,19	1,36	0,20%
Debênture simples	ELEK18	ELEKTRO S/A	67.785,43	67,45	0,19%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022	-	67.389,39	6,21	0,19%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB	66.248,36	87,10	0,19%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	65.209,68	64,85	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	61.822,87	62,66	0,17%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	57.374,36	1,14	0,16%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	56.729,90	0,22	0,16%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	54.573,89	5,33	0,15%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	52.718,32	5,11	0,15%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	51.998,74	51,47	0,15%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	52.136,12	52,40	0,15%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	47.356,31	0,28	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	45.063,86	45,17	0,13%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	46.289,16	64,56	0,13%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	43.811,43	0,15	0,12%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	39.463,59	0,23	0,11%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	39.239,34	0,77	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	35.744,09	3,54	0,10%
Debênture simples	SBSPB3	SABESP	33.697,75	34,69	0,09%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	31.691,49	3,00	0,09%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	31.523,64	0,14	0,09%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	31.003,78	0,62	0,09%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	30.668,00	0,11	0,09%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	30.668,00	0,11	0,09%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES S	29.831,49	29,31	0,08%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO RABOBANK	28.140,89	0,19	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	27.817,01	27,09	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	27.732,35	27,69	0,08%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	Banco Daycoval	26.569,66	0,12	0,07%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	SAFRA S/A	25.596,83	0,15	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A	25.582,26	24,86	0,07%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	25.351,88	0,14	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	25.457,93	24,62	0,07%
Debênture simples	SULM18	Sul América SA	25.095,36	24,75	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	24.570,53	24,23	0,07%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	24.712,02	0,48	0,07%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	Banco Daycoval	24.184,44	0,11	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	22.475,58	2,26	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	22.076,47	21,80	0,06%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	22.053,87	0,05	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025	-	22.127,77	20,09	0,06%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	20.974,68	0,12	0,06%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	19.615,86	0,39	0,05%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	Banco Daycoval	18.879,33	0,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	18.570,12	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	17.564,45	0,06	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	16.902,88	16,60	0,05%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	Banco Daycoval	16.606,04	0,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	14.987,27	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	14.504,83	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.143,43	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	13.143,43	0,05	0,04%
Depósitos a prazo e outros título	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	13.054,34	0,05	0,04%

Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	12.260,31	1,22	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	11.709,63	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	8.762,29	0,03	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	7.342,42	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	7.252,41	0,02	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.351,45	0,02	0,01%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	443,90	0,00	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1V23	-	156,65	0,80	0,00%
Mercado Futuro - Posições con	FUTDI1U21	-	-0,49	-0,12	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1J23	-	82,78	0,59	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1N24	-	68,34	0,36	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1N22	-	57,90	1,19	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1F25	-	53,36	0,25	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1J22	-	33,24	0,97	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1N23	-	30,64	0,19	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1V22	-	19,24	0,23	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1F26	-	9,04	0,05	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1F22	-	4,70	0,45	0,00%
Mercado Futuro - Posições ven	FUTDI1V21	-	0,21	0,08	0,00%
Mercado Futuro - Posições con	FUTDI1F24	-	-1.193,19	-6,04	0,00%
Mercado Futuro - Posições con	FUTDI1F23	-	-1.286,74	-10,99	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-33.403,79	0,00	-0,09%
Total			35.679.837,22		

QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

QT de Cotas 11981567

Renda Fixa

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021	-	5.105.960,45	470,14	35,72%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	565.101,72	2,66	3,95%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	552.449,32	10,96	3,86%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	533.326,32	10,30	3,73%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	3.071.168,11	3.748,82	21,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	379.100,48	7,31	2,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	377.042,02	7,31	2,64%
Títulos Públicos	LFT_08032019_01092025	-	328.191,47	30,57	2,30%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	307.344,42	5,98	2,15%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	285.710,66	27,91	2,00%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	280.908,69	1,33	1,97%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	258.410,59	259,82	1,81%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	250.298,10	4,98	1,75%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	181.545,83	17,94	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	179.652,48	0,33	1,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	154.237,02	2,99	1,08%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	149.353,33	152,17	1,04%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	140.459,61	140,88	0,98%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	134.588,05	2,66	0,94%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	104.693,33	10,63	0,73%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	93.565,37	0,33	0,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	89.379,37	0,33	0,63%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	87.988,73	0,33	0,62%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	72.269,73	0,33	0,51%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	70.227,17	0,33	0,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	69.066,94	1,33	0,48%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	65.045,35	12,96	0,46%
Debênture simples	KLBNA2	KLABIN S/A	58.238,70	5,98	0,41%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	58.127,55	81,07	0,41%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	53.552,55	0,33	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO. FI	52.428,98	0,33	0,37%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	42.870,69	4,32	0,30%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	38.624,86	38,87	0,27%
Debênture simples	LCAMA9	COMPANHIA DE LO	27.146,61	26,25	0,19%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	22.480,25	22,59	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	20.652,86	20,93	0,14%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES	15.216,03	14,95	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	10.068,65	1,00	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	6.009,93	0,66	0,04%