

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			58.143,97	0,0097%
Total do Disponível			58.143,97	0,0097%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Emprestimos		5.095.874,82	0,85%
Total Operações com Participantes			5.095.874,82	0,85%
<u>Fundos</u>				
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	153.151.893,09430200	551.699.755,22	92,23%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	764.165,63297439	19.882.251,53	3,32%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	11.981.566,53391740	14.003.737,34	2,34%
Vinci FI RF Imobiliário CP LP	Cotas de Fundos	20.000,00000000	2.197.531,41	0,37%
Sub-total			587.783.275,50	98,26%
Total Renda Fixa			587.783.275,50	98,26%
Depósito Judiciais/Recursois			215.566,58	0,04%
Total Depósito Judicial/Recursal			215.566,58	0,04%
<u>Estruturados</u>				
<u>FIP's</u>				
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	4.792,66395002	3.768.194,15	0,63%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	49,99999988	1.518.128,78	0,25%
Sub-total			5.286.322,93	0,88%
Total Estruturados			5.286.322,93	0,88%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			20.863,89	0,003%
Total Exigível Operacional			20.863,89	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			32.069,45	0,005%
Total Exigível Contingencial			32.069,45	0,005%
Total Plano III			598.170.683,88	100,00%

* Fundo Exclusivo

MARBELLA III - FI RENDA FIXA	QT de Cotas 153151893
Renda Fixa	

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		48.581.918,46	14.579,00	8,81%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		45.941.121,29	13.664,00	8,33%
Títulos Públicos	NTNB_14012009_15082020		19.262.510,19	5.677,00	3,49%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		16.311.862,18	3.942,00	2,96%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		16.304.173,00	3.842,00	2,96%
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025		14.376.260,61	12.293,00	2,61%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		11.162.856,07	3.196,00	2,02%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		104.291.836,70	33.501,00	18,90%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		99.731.386,42	25.481,00	18,08%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		72.541.949,30	23.019,00	13,15%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		64.358.290,00	22.654,00	11,67%
Debênture simples	TAE33	TRANSMISSORA AL	7.855.876,36	5.000,00	1,42%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		7.844.787,60	1.800,00	1,42%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		6.220.992,93	1.140,00	1,13%
Outros valores mobiliários regis CRI /ISEC /120109/120122 ISEC SECURITIZADOR			5.387.354,33	40,00	0,98%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		5.390.999,84	1.649,00	0,98%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		ITAU UNIBANCO S	4.366.041,04	6,00	0,79%
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB	1.529.045,12	3.000,00	0,28%
Debênture simples	RDCO24	ROD DAS COLINAS	332.197,94	100,00	0,06%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.280,66		0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		8.003,70		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-108.988,52		-0,02%
Total			551.699.755,22		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO
QT de Cotas 764166
Renda Fixa

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Valores a receber	Valores a Receber		267,22	0,00	0,00%
Disponibilidades	Disponibilidade		118,23	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-69.291,25	0,00	-0,35%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		6.659.552,19	624,39	33,49%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		1.674.328,70	443,94	8,42%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	486.089,59	2,32	2,44%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	337.755,85	2,00	1,70%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	263.540,44	1,56	1,33%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SANT BANESPA	258.475,07	5,09	1,30%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SANT BANESPA	256.755,85	5,09	1,29%
Depósitos a prazo e outros títulos	DPGE	BANCO CNH	251.730,42	0,25	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	181.210,26	0,71	0,91%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	179.876,26	1,06	0,90%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participação	369.467,16	36,16	1,86%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	149.515,60	2,97	0,75%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	139.279,78	0,65	0,70%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	212.616,14	21,05	1,07%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	95.605,17	0,24	0,48%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	156.328,96	15,71	0,79%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	94.488,92	0,21	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	89.412,76	0,13	0,45%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	80.607,52	1,60	0,41%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	124.013,38	130,15	0,62%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	70.766,25	72,19	0,36%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	122.874,47	127,97	0,62%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	198.746,41	200,07	1,00%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note	LOCALIZA	64.016,78	0,06	0,32%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	97.143,25	9,79	0,49%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	58.274,76	59,80	0,29%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	65.686,30	6,47	0,33%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	65.817,76	6,61	0,33%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		55.284,96	5,18	0,28%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	51.642,90	128,76	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	51.117,50	0,20	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	48.683,17	0,16	0,24%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	47.464,41	50,44	0,24%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	86.961,68	86,81	0,44%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	55.354,99	55,48	0,28%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	40.502,54	0,15	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	40.022,78	0,79	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	39.601,67	0,79	0,20%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		38.377,93	3,60	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	36.206,58	0,22	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	34.383,26	36,28	0,17%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	42.718,00	44.260,02	0,21%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	32.113,21	0,13	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	31.698,93	30,73	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	31.687,05	30,72	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	28.291,67	0,17	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	26.827,38	0,16	0,13%
Debênture simples	LAMEA2	LOJAS AMERICANA	38.271,30	3,95	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	25.603,18	0,09	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	25.141,30	0,15	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	24.423,93	0,11	0,12%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	53.006,94	55,48	0,27%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	22.388,60	0,10	0,11%

Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BANCO BRADESCO	22.356,15	0,13	0,11%
Debênture simples UNDA20	UNIDAS S/A	46.650,38	4,62	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	PARANA BANCO SA	21.242,42	0,10	0,11%
Debênture simples CEPE18	CELPE	62.071,41	6,25	0,31%
Debênture simples SBSBP3	SABESP	18.825,37	20,09	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BANCO BRADESCO	17.922,23	0,06	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BANCO ABC S/A	17.866,98	0,08	0,09%
Debênture simples HAPV11	Hapvida Part	64.297,07	67,67	0,32%
Debênture simples SEDU12	Somos Educação	17.486,11	17,41	0,09%
Debênture simples LORTA2	LOCALIZA RENT A	29.612,67	30,34	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	PARANA BANCO SA	16.282,62	0,07	0,08%
Debênture simples ELPLA3	ELETROPAULO MET	15.990,64	16,03	0,08%
Debênture simples CLOR11	Celeo Redes Tra	30.527,03	37,38	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	SAFRA S/A	14.512,68	0,09	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BANCO ABC S/A	14.344,25	0,08	0,07%
Títulos Públicos NTN_10012014_01012025		13.919,66	11,63	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	13.945,06	0,28	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	Banco Daycoval	13.683,63	0,06	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	13.346,83	12,88	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	13.346,64	12,88	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	Banco Daycoval	13.141,28	0,08	0,07%
Debênture simples CEEBB0	COELBA	12.871,11	1,31	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	12.530,21	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BANCO BRADESCO	12.348,00	0,03	0,06%
Debênture simples CBRDB6	CIA BRASILEIRA	12.306,08	12,63	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BANCO ABC S/A	11.886,26	0,07	0,06%
Debênture simples LORTA1	LOCALIZA RENT A	20.211,56	2,05	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	Banco Daycoval	10.692,28	0,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BANCO BRADESCO	10.530,44	0,02	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	10.441,84	0,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	10.409,96	10,18	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	10.409,96	10,18	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	Banco Daycoval	9.378,13	0,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	9.029,07	0,02	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	8.113,86	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BANCO BRADESCO	7.680,95	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	7.239,40	0,04	0,04%
Debênture simples LORTA3	LOCALIZA	6.853,94	0,71	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	6.619,95	0,02	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BANCO BRADESCO	6.058,40	0,04	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	BANCO BRADESCO	5.120,64	0,02	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.515,90	0,01	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	2.708,72	0,01	0,01%
Operações Compromissadas LFT_14072017_01092023		1.048,38	0,10	0,01%
Mercado Futuro - Posições com FUTDI1F23		13,78	2,59	0,00%
Mercado Futuro - Posições com FUTDI1J22		-2,26	-0,08	0,00%
Mercado Futuro - Posições com FUTDI1F25		-11,62	-0,15	0,00%
Mercado Futuro - Posições com FUTDI1F22		-303,47	-12,23	0,00%
Títulos Públicos NTN_10022010_15082050		981.473,43	206,79	4,94%
Títulos Públicos NTN_15102003_15082024		553.891,53	138,49	2,79%
Títulos Públicos NTN_15082004_15052045		553.476,40	121,27	2,78%
Títulos Públicos NTN_15012014_15052023		507.330,47	132,29	2,55%
Títulos Públicos NTN_07032006_15052035		495.141,23	111,76	2,49%
Títulos Públicos NTN_06012016_15052021		390.366,30	111,04	1,96%
Títulos Públicos NTN_10022010_15082040		322.000,12	70,49	1,62%
Títulos Públicos NTN_14012015_15052055		321.794,91	66,96	1,62%
Operações Compromissadas LTN_03012020_01012024		281.489,48	335,04	1,42%
Títulos Públicos NTN_10022010_15082030		271.741,76	62,98	1,37%
Títulos Públicos NTN_06012016_15082026		256.881,48	62,08	1,29%
Títulos Públicos NTN_08012020_15052025		186.418,88	46,61	0,94%

Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	148.918,27	35,09	0,75%
Títulos Públicos	NTNB_14012009_15082020	104.340,43	30,65	0,52%
Operações Compromissadas	NTNB_13102011_15082022	64.068,15	15,18	0,32%
Total		19.882.251,53		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		4.766.491,76	446,61	34,04%
Títulos Públicos	LFT_18072014_01092020		2.019.526,25	189,18	14,42%
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025		1.829.676,32	1.564,54	13,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	849.822,18	4,05	6,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	518.367,93	2,49	3,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	488.617,97	9,66	3,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	348.094,55	6,86	2,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	345.779,24	6,86	2,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	305.150,81	1,87	2,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	257.752,34	1,25	1,84%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	170.882,83	16,83	1,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	165.165,61	0,31	1,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	150.160,28	0,93	1,07%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	231.564,52	243,72	1,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	141.013,48	2,80	1,01%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	137.056,15	142,74	0,98%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	97.797,72	9,97	0,70%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	131.268,79	132,14	0,94%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	94.205,11	0,31	0,67%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	91.251,66	227,51	0,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	91.090,24	0,31	0,65%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	122.798,10	12,15	0,88%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	80.931,03	0,31	0,58%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	66.928,93	0,31	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	66.158,81	0,31	0,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	64.438,09	0,31	0,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	63.365,48	1,25	0,45%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	62.097,51	76,05	0,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO, FI	48.462,09	0,31	0,35%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	40.197,57	4,05	0,29%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS RENT A C	28.341,06	2,80	0,20%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	34.746,32	36,46	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	19.370,24	18,70	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	19.369,96	18,70	0,14%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	18.606,51	19,63	0,13%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	20.683,63	21,19	0,15%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	9.222,61	0,93	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	6.194,90	0,62	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.165,29	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber		789,83	0,00	0,01%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-2.866,37	0,00	-0,02%
Total			14.003.737,34		100,00%