

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			65.069,57	0,01%
Total do Disponível			65.069,57	0,01%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Emprestimos		5.105.788,97	0,85%
Total Operações com Participantes			5.105.788,97	0,85%
<u>Fundos</u>				
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	152.648.589,51542500	552.093.969,01	92,19%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	764.165,63297439	19.797.250,62	3,31%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	11.981.566,53391740	14.028.276,90	2,34%
Vinci FI RF Imobiliario CP LP	Cotas de Fundos	20.000,00000000	2.207.427,46	0,37%
Sub-total			588.126.923,99	98,21%
Total Renda Fixa			588.126.923,99	98,21%
Depósito Judiciais/Recursais			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	3.764.431,37	0,63%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	49,99999988	1.516.731,07	0,25%
Sub-total			5.281.162,44	0,88%
Total Estruturados			5.281.162,44	0,88%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			13.591,28	0,002%
Total Exigível Operacional			13.591,28	0,002%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			32.210,56	0,005%
Total Exigível Contingencial			32.210,56	0,005%
Total Plano III			598.840.313,39	100,00%
* Fundo exclusivo				

MARBELLA III - FI RENDA FIXA	QT de Cotas	152648590
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		47.530.395,66	14.579,00	8,61%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		44.952.395,68	13.664,00	8,14%
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025		30.502.640,13	26.488,00	5,52%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		15.707.030,20	3.942,00	2,84%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		15.655.201,99	3.842,00	2,84%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		105.402.850,63	27.727,00	19,09%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		105.134.203,80	33.501,00	19,04%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		70.960.085,76	23.019,00	12,85%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		64.939.690,93	22.654,00	11,76%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		10.920.160,09	3.196,00	1,98%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		8.128.106,97	1.800,00	1,47%
Debênture simples	TAE33	TRANSMISSORA AL	7.909.957,03	5.000,00	1,43%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		6.433.301,47	1.140,00	1,17%
Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública	CETIP_09A0010251	ISEC SECURITIZADORA SA	5.553.935,35	40,00	1,01%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		5.436.222,40	1.649,00	0,98%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	4.414.991,03	6,00	0,80%
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB	1.539.082,05	3.000,00	0,28%
Valores a receber	Valores a Receber		653.381,34		0,12%
Debênture simples	RDCO24	ROD DAS COLINAS	334.458,28	100,00	0,06%
Disponibilidades	Disponibilidade		10.130,99		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-24.252,77		0,00%
Total			552.093.969,01		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO		QT de Cotas	764166
Renda Fixa			

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		443,92	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		160,99	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-21.507,72	0,00	-0,11%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		6.647.779,67	622,29	33,58%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		1.671.285,01	451,03	8,44%
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025		854.496,43	742,03	4,32%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	485.274,36	2,31	2,45%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SANT BANESPA	258.188,23	5,07	1,30%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SANT BANESPA	256.288,50	5,07	1,29%
Depósitos a prazo e outros títulos	DPGE	BANCO CNH	251.650,23	0,25	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	181.287,27	0,70	0,92%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	179.582,26	1,05	0,91%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participaçõ	369.243,55	36,04	1,87%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	148.792,88	2,96	0,75%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	139.061,80	0,65	0,70%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	208.673,37	20,97	1,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	96.615,12	0,24	0,49%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	156.582,47	15,66	0,79%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	94.266,90	0,21	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	89.123,02	0,12	0,45%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	80.222,99	1,60	0,41%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	124.472,82	129,71	0,63%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	71.733,68	71,95	0,36%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	124.284,29	127,54	0,63%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	196.142,21	199,40	0,99%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note	LOCALIZA	63.968,53	0,06	0,32%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	97.281,65	9,76	0,49%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	58.073,33	59,60	0,29%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	65.977,95	6,45	0,33%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	65.146,13	6,59	0,33%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		55.188,12	5,16	0,28%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	51.591,81	128,32	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	51.032,56	0,20	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	48.271,67	0,16	0,24%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	46.782,78	50,27	0,24%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	86.876,45	86,52	0,44%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	55.252,48	55,29	0,28%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	40.441,06	0,15	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	39.925,00	0,78	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	39.530,39	0,78	0,20%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		38.310,77	3,58	0,19%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		36.203,73	43,57	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	36.146,66	0,22	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	34.560,79	36,16	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	32.126,86	0,12	0,16%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	42.549,77	44.111,04	0,21%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	31.627,02	30,62	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	31.615,51	30,61	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	26.780,35	0,16	0,14%
Debênture simples	LAMEA2	LOJAS AMERICANA	38.552,26	3,93	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	25.438,54	0,09	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	25.102,28	0,15	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	24.382,61	0,11	0,12%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	53.685,94	55,29	0,27%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	22.350,73	0,10	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	22.316,96	0,13	0,11%

Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	46.771,99	4,60	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	21.207,98	0,10	0,11%
Debênture simples	SBSBP3	SABESP	19.404,61	20,02	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	17.850,64	0,08	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	17.806,98	0,06	0,09%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	64.450,64	67,44	0,33%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	17.571,87	17,35	0,09%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	57.746,91	6,22	0,29%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	29.645,19	30,24	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	16.255,07	0,07	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPOLULO MET	15.970,68	15,98	0,08%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	30.588,42	37,26	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SAFRA S/A	14.489,70	0,09	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	14.346,22	0,08	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	13.893,53	0,28	0,07%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		13.603,52	11,59	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	13.654,70	0,06	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	13.328,55	12,84	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	13.328,35	12,84	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	13.120,44	0,08	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	12.829,94	1,30	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	12.511,30	0,05	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	12.319,09	0,03	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	12.272,30	12,58	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	11.877,11	0,07	0,06%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	20.199,05	2,04	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	10.669,37	0,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	10.514,41	0,02	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	10.426,08	0,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	10.391,02	10,15	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	10.390,95	10,15	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	9.322,14	0,04	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	8.952,85	0,02	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	8.045,28	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	7.631,56	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	7.227,42	0,04	0,04%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	6.917,37	0,70	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	6.564,53	0,02	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	5.087,71	0,02	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	4.477,79	0,01	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	2.685,85	0,01	0,01%
Mercado Futuro - Posições vend	FUTDI1F24		76,00	0,62	0,00%
Mercado Futuro - Posições com	FUTDI1J22		-3,15	-0,08	0,00%
Mercado Futuro - Posições com	FUTDI1F22		-64,94	-3,18	0,00%
Mercado Futuro - Posições vend	FUTDI1J23		63,02	0,91	0,00%
Mercado Futuro - Posições vend	FUTDI1V23		44,58	0,43	0,00%
Mercado Futuro - Posições vend	FUTDI1F25		27,29	0,15	0,00%
Mercado Futuro - Posições vend	FUTDI1N23		15,34	0,18	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		953.342,77	215,18	4,82%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		561.095,37	144,13	2,83%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		552.307,07	126,19	2,79%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		531.481,68	137,65	2,68%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		500.035,75	116,25	2,53%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		401.292,30	113,36	2,03%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		318.388,87	73,75	1,61%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		317.358,96	69,80	1,60%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		277.745,20	67,19	1,40%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		257.054,30	64,51	1,30%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		251.235,41	63,23	1,27%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		148.998,83	36,57	0,75%

Operações Compromissadas	NTNB_13102011_15082022	9.171,90	2,30	0,05%
Total		19.797.250,62		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		4.880.705,13	456,57	34,79%
Títulos Públicos	LFT_18072014_01092020		2.067.919,64	193,40	14,74%
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025		1.007.881,40	875,23	7,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	870.248,73	4,14	6,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	530.893,78	2,55	3,78%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	498.922,62	9,88	3,56%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	356.664,03	7,01	2,54%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	354.039,72	7,01	2,52%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	312.514,12	1,91	2,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	287.435,91	5,74	2,05%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	267.941,80	26,76	1,91%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	263.807,76	1,27	1,88%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	176.062,45	17,21	1,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	169.162,18	0,32	1,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	153.791,37	0,96	1,10%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	238.096,14	249,15	1,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	143.954,39	2,87	1,03%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	142.199,28	145,92	1,01%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	99.990,53	10,20	0,71%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	132.885,50	135,09	0,95%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	95.814,72	0,32	0,68%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	93.509,41	232,59	0,67%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	92.508,16	0,32	0,66%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	82.877,59	0,32	0,59%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	123.625,13	12,43	0,88%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	68.550,92	0,32	0,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	67.684,60	0,32	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	65.951,94	0,32	0,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	64.838,77	1,27	0,46%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	63.825,01	77,74	0,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO, FI	49.614,56	0,32	0,35%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	41.142,42	4,14	0,29%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS RENT A C	29.146,81	2,87	0,21%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	35.773,31	37,28	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	19.841,93	19,12	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	19.841,65	19,12	0,14%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	19.184,29	20,07	0,14%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	21.239,67	21,67	0,15%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	9.454,29	0,96	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	5.911,75	0,64	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.141,17	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber		586,53	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-904,18	0,00	-0,01%
Total			14.028.276,90		100,00%