

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			113.888,13	0,02%
Total do Disponível			113.888,13	0,02%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Emprestimos		5.083.167,46	0,85%
Total Operações com Participantes			5.083.167,46	0,85%
<u>Fundos</u>				
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	148.002.956,41307400	536.817.216,31	89,72%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.342.596,22148152	34.632.900,48	5,79%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	11.981.566,53391740	14.048.930,00	2,35%
Vinci FI RF Imobiliário CP LP	Cotas de Fundos	20.000,00000000	2.217.954,02	0,37%
Sub-total			587.717.000,81	98,22%
Total Renda Fixa			587.717.000,81	98,22%
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	4.792,66392001	3.760.666,89	0,63%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	49,99999988	1.515.215,99	0,25%
Sub-total			5.275.882,88	0,88%
Total Estruturados			5.275.882,88	0,88%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			15.388,24	0,003%
Total Exigível Operacional			15.388,24	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			32.326,52	0,005%
Total Exigível Contingencial			32.326,52	0,005%
Total Plano III			598.357.791,10	100,00%
* Fundo exclusivo				

MARBELLA III - FI RENDA FIXA	QT de Cotas	148002956
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		47.959.501,73	14.579,00	8,93%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		45.351.878,07	13.664,00	8,45%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		15.565.240,69	3.942,00	2,90%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		15.456.993,64	3.842,00	2,88%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		13.695.613,80	16.800,00	2,55%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		11.002.673,86	3.196,00	2,05%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		106.110.021,43	33.501,00	19,77%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		104.119.341,48	27.727,00	19,40%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		71.711.049,66	23.019,00	13,36%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		65.604.640,14	22.654,00	12,22%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		8.549.082,80	1.800,00	1,59%
Debênture simples	TAE33	TRANSMISSORA AL	7.973.925,55	5.000,00	1,49%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		6.753.516,90	1.140,00	1,26%
Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública	CRI /ISEC /120109/120122/08769451000 108	ISEC SECURITIZADORA SA	5.798.040,26	40,00	1,08%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		5.488.373,88	1.649,00	1,02%
	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	4.411.393,60	6,00	0,82%
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB	1.551.035,75	3.000,00	0,29%
Debênture simples	RDCO24	ROD DAS COLINAS	337.136,32	100,00	0,06%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.559,14		0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		229,76		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-632.032,15		-0,12%
Total			536.817.216,31		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO

1342596

Renda Fixa

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		298,50	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		9.702,74	0,00	0,03%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-17.040,06	0,00	-0,05%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		10.253.864,94	961,88	29,61%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		5.588.259,88	6.854,95	16,14%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	751.379,51	3,57	2,17%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SANT BANESPA	399.911,88	7,84	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SANT BANESPA	396.759,94	7,84	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos	DPGE	BANCO CNH	390.152,96	0,39	1,13%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	280.823,37	1,09	0,81%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participaçõ	571.789,41	55,70	1,65%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	230.711,96	4,58	0,67%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	215.330,40	1,01	0,62%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	323.499,91	32,42	0,93%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	149.863,12	0,37	0,43%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	242.921,69	24,20	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	145.833,31	0,32	0,42%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	137.754,54	0,19	0,40%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	124.371,29	2,47	0,36%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SAFRA S/A	120.828,63	2,41	0,35%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	193.287,42	200,49	0,56%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	111.241,62	111,21	0,32%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	193.814,40	197,14	0,56%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	303.993,85	308,21	0,88%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note	LOCALIZA	99.284,46	0,10	0,29%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	151.555,47	15,08	0,44%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	89.697,00	92,12	0,26%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	100.138,14	9,97	0,29%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	101.053,53	10,19	0,29%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		85.346,51	7,98	0,25%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	79.934,16	198,35	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	79.026,98	0,30	0,23%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	71.032,08	77,70	0,21%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	134.590,08	133,73	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	67.483,23	0,25	0,19%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	84.346,62	85,46	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	62.618,77	0,23	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	61.826,24	1,21	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	61.198,86	1,21	0,18%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		59.190,85	5,54	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	55.980,60	0,34	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	53.673,75	55,89	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	49.766,17	0,19	0,14%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	65.727,89	68.182,95	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	49.004,63	47,33	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	48.986,78	47,32	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	41.462,29	0,25	0,12%
Debênture simples	LAMEA2	LOJAS AMERICANA	60.662,10	6,08	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	39.202,60	0,14	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	38.869,91	0,23	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	37.766,94	0,17	0,11%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	82.302,08	85,46	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	34.619,70	0,15	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	34.551,91	0,21	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	32.845,29	0,15	0,09%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	71.271,45	7,11	0,21%

Debênture simples	SBSPB3	SABESP	30.147,79	30,95	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	27.646,84	0,12	0,08%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	100.135,09	104,25	0,29%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	27.441,82	0,10	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	27.441,82	0,10	0,08%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	89.595,71	9,62	0,26%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	45.958,14	46,74	0,13%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	26.736,12	26,82	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	25.177,96	0,11	0,07%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPOL MET	24.389,46	24,70	0,07%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	47.561,25	57,59	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SAFRA S/A	22.436,57	0,14	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	22.214,09	0,12	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	21.542,96	0,43	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	21.147,24	0,10	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		20.758,27	17,92	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	20.320,09	0,12	0,06%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	19.923,43	2,01	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	19.374,61	0,08	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	19.058,16	0,04	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	18.649,61	19,45	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	18.394,11	0,11	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	31.373,71	3,16	0,09%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	16.527,48	0,07	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	16.280,01	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	16.145,50	0,07	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	16.094,95	15,69	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	16.094,84	15,69	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	15.149,42	0,06	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	14.404,22	0,07	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.496,90	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	11.760,78	0,04	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	11.247,21	0,04	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	11.193,16	0,07	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	10.756,17	1,09	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	10.099,61	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	7.840,52	0,03	0,02%
Mercado Futuro - Posições com	FUTDI1F22		7.260,31	39,89	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	6.248,45	0,01	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	3.749,07	0,01	0,01%
Operações Compromissadas	LFT_14072017_01092023		735,49	0,07	0,00%
Mercado Futuro - Posições com	FUTDI1J22		24,61	0,12	0,00%
Mercado Futuro - Posições com	FUTDI1F25		-83,49	-0,22	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.626.968,25	380,73	4,70%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		1.455.104,39	392,55	4,20%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		985.643,17	255,80	2,85%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		951.817,14	223,38	2,75%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		938.230,28	244,38	2,71%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		862.162,09	205,55	2,49%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		716.908,30	200,88	2,07%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		551.302,22	131,51	1,59%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		551.050,40	125,24	1,59%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		547.777,80	139,05	1,58%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		494.916,63	123,42	1,43%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		453.029,96	114,73	1,31%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		262.167,54	65,16	0,76%
Total			34.632.900,48		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		5.084.907,24	475,18	36,19%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		2.635.681,05	3.233,11	18,76%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	907.278,02	4,31	6,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	553.545,24	2,65	3,94%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	520.701,53	10,28	3,71%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	371.973,65	7,30	2,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	369.041,90	7,30	2,63%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	325.890,66	1,99	2,32%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	300.025,41	5,97	2,14%
Debênture simples	BSA313	BOVESPA/BMF	279.706,81	27,85	1,99%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	275.221,64	1,33	1,96%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	179.925,39	17,91	1,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	176.380,17	0,33	1,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	160.354,12	0,99	1,14%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	249.078,58	259,31	1,77%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	150.293,45	2,98	1,07%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	149.311,14	151,87	1,06%
Debênture simples	NTSD12	NOVA TRANSP NTS	104.082,25	10,61	0,74%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	138.674,40	140,60	0,99%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	97.551,04	242,07	0,69%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	95.782,87	0,33	0,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	90.190,51	0,33	0,64%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	86.415,20	0,33	0,62%
Debênture simples	VIVT15	TELEFONICA	129.044,32	12,93	0,92%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	71.476,33	0,33	0,51%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	70.566,59	0,33	0,50%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	68.805,41	0,33	0,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	67.606,37	1,33	0,48%
Debênture simples	CLOR11	CELEO R T ENERG	66.820,86	80,91	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	51.993,41	0,33	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO, FI	51.711,20	0,33	0,37%
Debênture simples	BSA312	BOVESPA/BMF	42.687,88	4,31	0,30%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS RENT A C	29.905,14	2,98	0,21%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	37.403,57	38,80	0,27%
Debênture simples	CPGT16	COPEL	20.060,83	20,89	0,14%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	22.170,78	22,55	0,16%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	9.887,56	0,99	0,07%
Debênture simples	CEPE18	COMPANHIA ENERG	6.175,88	0,66	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.125,59	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber		34,74	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-2.558,75	0,00	-0,02%
Total			14.048.930,00		100,00%