

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			160.677,15	0,03%
Total do Disponível			160.677,15	0,03%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		4.880.719,29	0,81%
Total Operações com Participantes			4.880.719,29	0,81%
<u>Fundos</u>				
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	147.428.764,3061	542.110.542,08	89,82%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.342.596,2215	34.679.697,10	5,75%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	11.981.566,5339	14.072.754,16	2,33%
Vinci FI RF Imobiliário CP LP	Cotas de Fundos	20.000,0000	2.224.901,08	0,37%
Sub-total			593.087.894,42	98,26%
Total Renda Fixa			593.087.894,42	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	4.792,6640	3.756.910,89	0,62%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	50,0000	1.513.836,09	0,25%
Sub-total			5.270.746,98	0,87%
Total Estruturados			5.270.746,98	0,87%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			17.060,73	0,003%
Total Exigível Operacional			17.060,73	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			32.607,76	0,005%
Total Exigível Contingencial			32.607,76	0,005%
Total Plano III			603.565.935,93	100,00%
* Fundo exclusivo				

MARBELLA III - FI RENDA FIXA	QT de Cotas	147428764
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		109.405.777,73	34.082,62	20,18%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		74.033.735,25	23.418,64	13,66%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		67.706.496,63	23.047,30	12,49%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		106.814.463,36	28.208,38	19,70%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		49.436.681,06	14.832,11	9,12%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		46.742.195,46	13.901,22	8,62%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		15.773.894,75	4.010,44	2,91%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		15.662.364,15	3.908,70	2,89%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		12.768.233,20	15.694,83	2,36%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		11.325.017,10	3.251,49	2,09%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		8.796.024,81	1.831,25	1,62%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		7.144.946,84	1.159,79	1,32%
Outros valores mobiliários regis	CETIP_09A0010251	ISEC SECURITIZADOR	6.158.663,59	40,69	1,14%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		5.660.588,23	1.677,63	1,04%
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	4.482.273,24	6,10	0,83%
Valores a receber	Valores a Receber		215.213,04		0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.417,46		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-25.443,82		0,00%
Total			542.110.542,08		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO

1342596

Renda Fixa

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		301,42	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		255,68	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-19.407,87	0,00	-0,06%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		10.280.296,10	964,36	29,64%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		5.639.696,69	6.918,18	16,26%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	753.316,32	3,58	2,17%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SANT BANESPA	400.942,72	7,86	1,16%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SANT BANESPA	397.782,66	7,86	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos	DPGE	BANCO CNH	391.158,65	0,39	1,13%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	281.547,24	1,09	0,81%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participação	573.263,29	55,85	1,65%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	231.306,66	4,59	0,67%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	215.885,46	1,01	0,62%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	324.333,79	32,50	0,94%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	150.249,42	0,37	0,43%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	243.547,86	24,27	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	146.209,23	0,32	0,42%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	138.109,62	0,19	0,40%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	124.691,88	2,47	0,36%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SAFRA S/A	121.140,09	2,42	0,35%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	193.785,65	201,01	0,56%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	111.528,37	111,50	0,32%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	194.313,99	197,65	0,56%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	304.777,45	309,01	0,88%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note	LOCALIZA	99.540,38	0,10	0,29%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	151.946,13	15,12	0,44%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	89.928,21	92,36	0,26%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	100.396,27	9,99	0,29%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	101.314,01	10,21	0,29%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		85.566,51	8,00	0,25%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	80.140,20	198,86	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	79.230,69	0,30	0,23%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	71.215,18	77,90	0,21%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	134.937,01	134,08	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	67.657,18	0,25	0,20%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	84.564,04	85,68	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	62.780,18	0,23	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	61.985,61	1,22	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	61.356,61	1,22	0,18%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		59.343,43	5,56	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	56.124,90	0,35	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	53.812,10	56,04	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	49.894,45	0,19	0,14%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	65.897,31	68.358,70	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	49.113,05	47,44	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	49.130,95	47,46	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	41.569,16	0,25	0,12%
Debênture simples	LAMEA2	LOJAS AMERICANA	60.818,47	6,09	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	39.303,65	0,14	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	38.970,11	0,23	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	37.864,29	0,17	0,11%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	82.514,23	85,68	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	34.708,93	0,15	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	34.640,97	0,21	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	32.929,95	0,15	0,09%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	71.455,17	7,13	0,21%

Debênture simples	SBSPB3	SABESP	30.225,50	31,03	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	27.718,11	0,12	0,08%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	100.393,20	104,52	0,29%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	27.512,55	0,10	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	27.512,55	0,10	0,08%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	89.826,66	9,65	0,26%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	46.076,60	46,86	0,13%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	26.805,04	26,89	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	25.242,86	0,11	0,07%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	24.452,33	24,76	0,07%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	47.683,84	57,74	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	SAFRA S/A	22.494,41	0,14	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	22.271,36	0,12	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	21.598,49	0,43	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	21.201,76	0,10	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		20.811,78	17,97	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	20.372,47	0,12	0,06%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	19.974,79	2,02	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	19.424,55	0,08	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	19.107,29	0,04	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	18.697,69	19,50	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	18.441,52	0,11	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	16.570,08	0,07	0,05%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	31.454,58	3,16	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	16.321,98	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	16.187,12	0,07	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	16.136,44	15,73	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	16.136,33	15,73	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	15.188,47	0,06	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	Banco Daycoval	14.441,35	0,07	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	12.529,11	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	11.791,09	0,04	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	11.276,20	0,04	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	11.222,01	0,07	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	10.783,90	1,09	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	10.125,65	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	7.860,73	0,03	0,02%
Mercado Futuro - Posições com FUTDI1F22			7.279,02	39,99	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	6.264,55	0,01	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	3.758,73	0,01	0,01%
Operações Compromissadas	LFT_14072017_01092023		737,38	0,07	0,00%
Mercado Futuro - Posições com FUTDI1J22			24,67	0,12	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		-83,70	-0,22	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.629.996,12	378,61	4,70%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		1.453.749,79	389,49	4,19%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		977.436,85	253,40	2,82%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		948.462,79	221,91	2,73%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		928.709,74	242,07	2,68%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		857.122,92	204,38	2,47%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		693.657,81	192,60	2,00%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		569.485,79	144,52	1,64%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		548.767,68	124,15	1,58%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		547.390,82	129,86	1,58%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		496.964,66	122,34	1,43%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		447.277,21	113,72	1,29%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		257.142,17	64,17	0,74%
Total			34.679.697,10		100,00%

QUIMERA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

QT de Cotas 11981566

Renda Fixa

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	LFT_08052015_01092021		5.763.617,72	537,67	40,96%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		2.913.226,06	3.580,96	20,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	1.028.066,59	4,88	7,31%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	627.267,33	3,00	4,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	590.801,97	11,63	4,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	421.758,90	8,25	3,00%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	418.121,26	8,25	2,97%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	369.461,67	2,25	2,63%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	340.464,26	6,75	2,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	312.111,52	1,50	2,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	199.916,31	0,38	1,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	181.610,49	1,13	1,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	170.589,00	3,38	1,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	102.034,38	0,38	0,73%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	99.887,68	0,38	0,71%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	97.952,70	0,38	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	81.026,29	0,38	0,58%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	79.936,65	0,38	0,57%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	78.027,88	0,38	0,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	76.621,25	1,50	0,54%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	58.815,28	0,38	0,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO, FI	57.966,02	0,38	0,41%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.446,14	0,00	0,02%
Valores a receber	Valores a Receber		1.435,22	0,00	0,01%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-1.408,40	0,00	-0,01%
Total			14.072.754,16		100,00%