

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			162.561,88	0,027%
Total do Disponível			162.561,88	0,027%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Emprestimos		5.030.858,92	0,82%
Total Operações com Participantes			5.030.858,92	0,82%
<u>Fundos</u>				
*Marbella III - FI RF	Cotas de Fundos	146.915.100,8281	548.448.038,61	89,82%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	1.342.596,2215	34.946.299,02	5,72%
*Quimera - FI RF	Cotas de Fundos	11.981.566,5339	14.096.801,52	2,31%
Vinci FI RF Imobiliário CP LP	Cotas de Fundos	20.000,0000	2.243.396,30	0,37%
Sub-total			599.734.535,45	98,22%
Total Renda Fixa			599.734.535,45	98,22%
Depósito Judiciais/Recurais			215.566,58	0,04%
Total Depósito Judicial/Recursal			215.566,58	0,04%
<u>Estruturados</u>				
FIP's				
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	4.792,6639	3.980.746,11	0,65%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	50,0000	1.512.224,47	0,25%
Sub-total			5.492.970,58	0,90%
Total Estruturados			5.492.970,58	0,90%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			20.677,37	0,003%
Total Exigível Operacional			20.677,37	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			32.897,97	0,005%
Total Exigível Contingencial			32.897,97	0,005%
Total Plano III			610.582.918,07	100,00%

*Plano exclusivo

MARBELLA III - FI RENDA FIXA	QT de Cotas	146915101
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		107.430.464,50	34.082,78	19,93
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		75.099.925,32	23.418,75	13,93
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		66.349.151,71	23.047,41	12,31
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		109.063.088,88	28.208,51	20,23
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		50.075.103,97	14.832,18	9,29
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		47.339.506,85	13.901,29	8,78
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		16.679.235,67	20.365,63	3,09
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		16.043.724,59	4.010,46	2,98
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		15.987.665,64	3.908,72	2,97
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		11.455.329,25	3.251,50	2,13
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		9.159.364,06	1.831,26	1,70
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		7.426.489,43	1.159,80	1,38
Outros valores mobiliários regis	CETIP_09A0010251	ISEC SECURITIZADOR	6.383.433,17	40,69	1,18
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		5.568.644,08	1.677,64	1,03
Depósitos a prazo e outros títul	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	4.548.716,27	6,10	0,84
Disponibilidades	Disponibilidade		9.593,06		0,00
Valores a receber	Valores a Receber		4.524,90		0,00
Valores a pagar	Valores a Pagar		-175.921,32		-0,03
Total			548.448.040,01		100,00

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO	QT de Cotas	1342596
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		481,33	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		12.829,25	0,00	0,04%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-24.359,85	0,00	-0,07%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		10.401.831,17	972,72	29,77%
Operações Compromissadas	NTNF_15012016_01012027		4.842.834,59	4.261,70	13,86%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	774.231,50	3,66	2,22%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		SANT BANESPA	412.125,54	8,05	1,18%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		SANT BANESPA	408.821,52	8,05	1,17%
Depósitos a prazo e outros títulos DPGE		BANCO CNH	402.812,27	0,40	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos DPGE		BANCO C6 S.A	397.665,44	0,40	1,14%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO ITAU S/A	289.684,57	1,12	0,83%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participação	588.940,66	57,17	1,69%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BCO VOTORANTIM	238.244,31	4,70	0,68%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	221.754,92	1,03	0,63%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	333.419,07	33,28	0,95%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	155.345,67	0,38	0,44%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	248.717,14	24,84	0,71%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	150.907,44	0,33	0,43%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	142.843,77	0,20	0,41%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BCO ALFA DE INV	128.396,39	2,53	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		SAFRA S/A	124.652,08	2,48	0,36%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	200.073,22	205,78	0,57%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	113.139,77	114,14	0,32%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	243.873,77	252,54	0,70%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	313.443,17	316,35	0,90%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial Paper/ Exp	LOCALIZA	102.344,76	0,10	0,29%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	154.461,48	15,48	0,44%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	91.290,56	94,55	0,26%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	103.340,55	10,23	0,30%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		87.857,61	8,19	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO ITAU S/A	81.407,64	0,31	0,23%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	87.516,43	8,76	0,25%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	138.700,70	137,26	0,40%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	69.755,20	79,75	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	68.685,53	0,25	0,20%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	87.773,78	87,72	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BCO ALFA DE INV	64.533,35	0,24	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO CITIBANK	63.712,32	1,25	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BCO ALFA DE INV	63.086,21	1,25	0,18%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		60.946,80	5,69	0,17%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	58.996,09	59,38	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BC FIDIS INVEST	57.678,16	0,35	0,17%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	55.317,35	57,37	0,16%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	69.125,97	69.982,24	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO ITAU S/A	51.336,51	0,20	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos CDB/ RDB		BANCO GMAC S/A	50.505,65	48,58	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos CDB/ RDB		BANCO GMAC S/A	50.486,49	48,57	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	42.723,23	0,25	0,12%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	41.019,95	41,35	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	39.966,55	0,14	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		PARANA BANCO SA	38.921,24	0,17	0,11%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	85.726,52	87,72	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		PARANA BANCO SA	35.677,80	0,16	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	35.602,69	0,21	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		PARANA BANCO SA	33.841,95	0,16	0,10%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	93.501,87	9,28	0,27%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	32.223,33	3,11	0,09%

Debênture simples	SBSPB3	SABESP	30.605,60	31,76	0,09%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	47.284,83	47,13	0,14%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	29.037,35	2,74	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO ABC S/A	28.486,70	0,13	0,08%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	146.669,50	151,07	0,42%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	92.575,67	9,88	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	27.976,59	0,10	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	27.976,59	0,10	0,08%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	46.982,64	47,98	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		PARANA BANCO SA	25.947,49	0,11	0,07%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	25.210,51	25,35	0,07%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	24.818,90	24,80	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		SAFRA S/A	23.117,18	0,14	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO ABC S/A	22.890,12	0,13	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BCO VOTORANTIM	22.247,28	0,44	0,06%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	22.245,21	22,18	0,06%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	44.708,05	59,11	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		Banco Daycoval	21.798,48	0,10	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		21.279,47	18,39	0,06%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	20.290,17	2,07	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	20.054,78	19,96	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	19.721,42	0,04	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO ABC S/A	18.952,73	0,11	0,05%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	18.296,82	18,22	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		Banco Daycoval	17.035,35	0,07	0,05%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	32.315,61	3,24	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	16.772,22	0,03	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos CDB/ RDB		BANCO GMAC S/A	16.586,72	16,10	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos CDB/ RDB		BANCO GMAC S/A	16.586,59	16,10	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	15.425,83	0,06	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		Banco Daycoval	14.827,30	0,07	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	13.117,66	0,04	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	12.719,54	0,03	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	11.989,97	0,04	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	11.989,97	0,04	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BC FIDIS INVEST	11.532,58	0,07	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	11.447,59	0,04	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	11.106,05	1,12	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	10.283,89	0,03	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		BANCO BRADESCO	7.993,31	0,03	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	6.359,77	0,01	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos Letra Financeira		ITAU UNIBANCO H	3.815,86	0,01	0,01%
Operações Compromissadas	LFT_14072017_01092023		1.660,56	0,16	0,00%
Mercado Futuro - Posições venc	FUTDI1F25		43,25	0,23	0,00%
Mercado Futuro - Posições com	FUTDI1J22		-3,82	-0,13	0,00%
Mercado Futuro - Posições com	FUTDI1F22		-1.541,70	-36,56	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.611.937,46	363,77	4,61%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		1.420.579,67	376,11	4,07%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		1.174.946,12	310,22	3,36%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		955.664,51	245,98	2,73%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		908.443,27	213,96	2,60%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		825.909,13	196,57	2,36%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		657.745,97	185,54	1,88%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		653.995,64	167,76	1,87%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		549.182,17	127,74	1,57%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		548.475,75	123,09	1,57%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		521.139,58	125,23	1,49%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		434.450,14	110,67	1,24%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		255.027,24	62,35	0,73%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		36.791,22	44,92	0,11%

Total

34.946.299,03

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		5.807.452,80	540,89	41,20%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		2.855.129,55	3.486,16	20,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	1.036.782,04	4,91	7,35%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ALFA INVESTIMEN	632.708,02	3,02	4,49%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	595.902,66	11,70	4,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	425.121,41	8,30	3,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO SANTANDER	421.713,21	8,30	2,99%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	372.360,67	2,26	2,64%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	343.448,47	6,79	2,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	314.651,56	1,51	2,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	201.503,51	0,38	1,43%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	183.054,53	1,13	1,30%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	172.120,74	3,40	1,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIB HOLDI	101.804,22	0,38	0,72%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	98.722,36	0,38	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	95.475,33	0,38	0,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	81.656,90	0,38	0,58%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	80.653,45	0,38	0,57%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	78.662,89	0,38	0,56%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	77.263,40	1,51	0,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	59.354,68	0,38	0,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	CIA CRÉDITO, FI	58.520,47	0,38	0,42%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.525,17	0,00	0,03%
Valores a receber	Valores a Receber		766,53	0,00	0,01%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-1.553,04	0,00	-0,01%
Total			14.096.801,52		100,00%