

jan/21

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			526.347,25	0,006%
Total do Disponível			526.347,25	0,006%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		145.947.482,26	1,69%
Financiamentos	Financiamentos		1.334.370,34	0,02%
Total Operações com Participantes			147.281.852,60	1,71%
<u>Fundos</u>				
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	1.485.652.887	7.898.966.974,29	91,50%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	17.648.939	466.729.420,53	5,41%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	31.268.246	81.947.039,39	0,95%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	76.403	8.298.700,63	0,10%
Sub-total			8.455.942.134,84	97,96%
<u>F.I.D.C.</u>				
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	6,00000	102.616,01	0,00%
Sub-total			102.616,01	0,00%
Total Renda Fixa			8.456.044.750,85	97,96%
<u>Imobiliário</u>				
Campinas	Imóveis		19.182.682,35	0,22%
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	28.096,00000	5.759.680,00	0,07%
RCRB 11 FII Rio Bravo Renda Corporativa	Cotas de Fundos	26.209,00000	4.403.112,00	0,05%
Total Imobiliário			29.345.474,35	0,34%
<u>Estruturados</u>				
<u>FIP's</u>				
FIP Brasil Energia Multiestrategia	Cotas de Fundos	390,20986	179.836,35	0,00%
FIP Multiestratégia Brasil Petroleo 1	Cotas de Fundos	16.012,83537	2.172,84	0,00%
Total Estruturados			182.009,19	0,00%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			379.107,27	0,00%
Total Exigível Operacional			379.107,27	0,00%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			597.078,41	0,01%
Total Exigível Contingencial			597.078,41	0,01%
Total Plano II			8.632.404.248,56	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA II - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas	1485652887
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		632.944.215,94	141.341,00	8,01%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		376.197.179,68	86.871,00	4,76%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		360.085.046,93	78.498,00	4,56%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		2.892.180.268,60	317.082,00	36,61%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		273.570.396,96	50.790,00	3,46%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.410.008.714,58	299.635,00	17,85%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		889.574.010,57	195.504,00	11,26%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		844.467.444,37	210.466,00	10,69%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		77.082.233,18	92.665,00	0,98%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		65.165.323,40	15.769,00	0,82%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		64.994.064,12	15.370,00	0,82%
Títulos Públicos	NTNB_15032002_15032023		20.957.721,90	5.414,00	0,27%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		ITAU UNIBANCO S	17.488.178,99	23,00	0,22%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		SAFRA S/A	6.827.937,71	6,00	0,09%
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB	2.727.634,12	5.000,00	0,03%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.259,25		0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		16.988,72		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-35.329.644,73		-0,45%
Total			7.898.966.974,29		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	17648939
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	22.104.533,85	26.139,61	4,74%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050	-	20.993.476,02	4.461,24	4,50%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	-	19.258.136,87	4.983,57	4,13%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023	-	146.615.493,27	13.665,25	31,41%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024	-	12.009.599,83	2.993,15	2,57%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045	-	11.893.793,03	2.613,93	2,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	10.910.658,91	51,48	2,34%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035	-	10.820.156,97	2.416,22	2,32%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022	-	52.208.870,96	13.640,03	11,19%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025	-	8.949.290,70	2.224,89	1,92%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021	-	8.157.595,30	2.283,57	1,75%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055	-	7.352.717,97	1.560,73	1,58%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030	-	7.258.778,67	1.676,19	1,56%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	-	7.245.029,41	1.579,40	1,55%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	-	5.948.703,38	1.439,49	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	5.802.262,08	113,09	1,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	5.764.418,48	113,09	1,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	5.676.792,50	5,56	1,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO C6 SA	5.601.849,04	5,56	1,20%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	4.696.556,92	467,47	1,01%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	4.426.437,63	4.444,18	0,95%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	4.077.880,95	15,70	0,87%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	3.438.513,62	3.547,79	0,74%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	3.353.922,14	65,99	0,72%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	-	3.217.943,09	760,99	0,69%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	3.120.908,52	14,51	0,67%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	2.802.650,59	2.890,90	0,60%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	2.189.895,60	5,37	0,47%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	2.174.688,37	217,44	0,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.129.430,82	4,57	0,46%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	2.076.796,41	2.122,31	0,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.017.937,82	2,78	0,43%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	1.820.865,17	1.831,54	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	1.805.763,18	35,58	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	1.748.046,10	34,78	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	1.682.199,20	33,59	0,36%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	1.456.638,53	143,70	0,31%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Comercial	LOCALIZA	1.443.269,42	1,39	0,31%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	1.317.526,36	130,38	0,28%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU SA	1.293.214,34	1.328,28	0,28%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	1.309.378,48	138,73	0,28%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022	-	1.236.683,33	115,08	0,26%
Debênture simples	SSED	SABER SERVIÇOS	1.233.252,54	123,03	0,26%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	1.236.366,96	1.232,28	0,26%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	1.209.294,98	1.232,28	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	1.146.083,77	4,37	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	1.127.850,96	22,46	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	1.113.383,48	22,26	0,24%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	1.061.260,98	1.057,38	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	985.245,34	3,58	0,21%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB	957.447,34	1.120,39	0,21%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	974.120,73	983.143,13	0,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	909.814,09	3,38	0,19%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	899.971,16	899,37	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	897.615,60	17,49	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	890.242,56	17,49	0,19%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022	-	858.069,34	79,90	0,18%

Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	832.160,00	834,18	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	811.941,10	4,97	0,17%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	781.363,63	805,95	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	722.662,45	2,78	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	710.694,57	682,33	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	710.962,48	682,53	0,15%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	699.514,55	68,57	0,15%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	666.524,95	662,06	0,14%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	663.998,23	673,98	0,14%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	630.124,63	830,40	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	602.269,88	3,58	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	577.668,61	580,96	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	570.525,29	1,99	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	547.958,81	2,38	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	502.295,57	2,18	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	501.891,57	2,98	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	476.401,39	2,18	0,10%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	454.219,63	43,73	0,10%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	450.763,13	45,52	0,10%
Debênture simples	SBSBP3	SABESP	431.558,31	446,21	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	401.121,71	1,79	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	399.367,70	1,39	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	399.367,70	1,39	0,09%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	399.491,97	38,56	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	365.305,87	1,59	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	355.691,73	356,17	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	350.039,27	348,42	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	335.950,93	1,59	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A	326.514,00	319,80	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	325.625,40	1,99	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	322.565,03	1,79	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	316.778,16	316,62	0,07%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025	-	311.410,54	258,38	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	313.700,55	311,65	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	312.785,97	6,16	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	307.170,84	1,39	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	286.509,08	29,02	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	282.283,49	280,45	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	278.279,89	0,60	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	266.883,79	1,59	0,06%
Debênture simples	SEDU	Somos Educação	257.845,08	256,00	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	239.942,91	0,99	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	236.275,63	0,40	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	221.000,21	0,79	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	213.627,24	213,46	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	209.969,33	0,99	0,04%
Operações Compromissadas	NTNB_06012016_15052021	-	249.569,51	69,86	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	187.353,86	0,60	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	182.452,84	0,40	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	171.157,59	0,60	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	171.157,59	0,60	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	164.207,55	0,60	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	162.345,25	0,99	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	154.908,96	15,70	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	147.333,47	0,40	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	114.105,06	0,40	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	91.226,42	0,20	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	54.735,85	0,20	0,01%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	4.587,77	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber	-	3.526,63	0,00	0,00%

Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F23	-	19.585,80	248,05	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22	-	50,91	1,79	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25	-	-326,44	-3,18	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-438.884,59	0,00	-0,09%
TOTAL		-	466.729.420,53	0,00	100,00%

QUIRON FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5+	QT de Cotas	31268246
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		8.086.125,62	1.716,41	9,87%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		7.948.745,82	1.835,51	9,70%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		7.804.067,90	1.701,28	9,52%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		6.501.419,74	1.573,24	7,93%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		3.538.791,05	836,86	4,32%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		23.131.874,03	4.915,66	28,23%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		13.053.014,88	2.868,70	15,93%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		11.868.245,14	2.650,26	14,48%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		20.009,45	24,05	0,02%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.743,89	-	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		2.422,64	-	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-11.420,78	-	-0,01%
Total			81.947.039,39		100,00%