

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			505.029,89	0,006%
Total do Disponível			505.029,89	0,006%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		145.739.309,60	1,66%
Financiamentos	Financiamentos		1.236.242,18	0,01%
Total Operações com Participantes			146.975.551,78	1,68%
<u>Fundos</u>				
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	1.457.608.226	8.025.724.377,94	91,60%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	17.648.939	469.025.046,38	5,35%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	31.268.246	80.515.317,39	0,92%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	106.364	11.375.926,45	0,13%
Sub-total			8.586.640.668,16	98,00%
<u>F.I.D.C.</u>				
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	6,000000	298.090,64	0,003%
Sub-total			298.090,64	0,003%
Total Renda Fixa			8.586.938.758,80	98,00%
<u>Imobiliário</u>				
Campinas	Imóveis		19.038.387,66	0,22%
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	28.096,000000	5.679.044,48	0,06%
RCRB 11 FII Rio Bravo Renda Corporativa	Cotas de Fundos	26.209,000000	3.758.370,60	0,04%
Total Imobiliário			28.475.802,74	0,32%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			421.736,00	0,005%
Total Exigível Operacional			421.736,00	0,005%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			611.104,14	0,01%
Total Exigível Contingencial			611.104,14	0,01%
Total Plano II			8.761.862.303,07	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA II - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA			QT de Cotas	1457608226
Renda Fixa				

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		600.244.289,94	141.341,00	7%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		359.068.876,89	86.871,00	4%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		345.821.680,82	78.498,00	4%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		3.157.635.053,45	317.082,00	39%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		285.012.113,77	347.900,00	4%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.354.637.811,24	299.635,00	17%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		862.545.152,09	195.504,00	11%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		849.062.404,95	215.591,00	11%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		83.492.722,63	20.757,00	1%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		62.680.469,51	15.370,00	1%
Títulos Públicos	NTNB_15032002_15032023		20.773.799,54	5.414,00	0%
Valores a receber	Valores a Receber		20.311.365,40		0%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		ITAU UNIBANCO S	17.788.940,01	23,00	0%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		SAFRA S/A	6.925.706,00	6,00	0%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.551,51		0%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-285.559,81		0%
Total			8.025.724.377,94		100%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO
QT de Cotas 17648939
Renda Fixa

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023	-	33.721.108,54	8.833,47	7,19%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024	-	19.630.820,63	23.962,36	4,19%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050	-	19.538.881,26	4.341,64	4,17%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022	-	16.649.153,88	4.437,31	3,55%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024	-	16.403.039,45	4.174,90	3,50%
Operações Compromissadas	LFT_08072016_01092022	-	97.864.011,27	9.030,30	20,87%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	11.277.306,51	52,61	2,40%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045	-	11.089.556,33	2.513,55	2,36%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035	-	9.880.440,58	2.336,47	2,11%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023	-	52.232.380,48	4.825,02	11,14%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055	-	9.066.244,87	2.024,23	1,93%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030	-	9.001.619,46	2.177,80	1,92%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	-	8.693.261,83	2.180,03	1,85%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025	-	8.420.553,60	2.166,76	1,80%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	-	7.280.236,12	1.652,54	1,55%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	6.481.604,24	128,78	1,38%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	5.994.262,15	115,58	1,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	5.961.714,23	115,58	1,27%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	-	5.954.903,02	1.460,21	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	5.898.598,64	5,69	1,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO C6 SA	5.809.132,55	5,69	1,24%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	5.060.073,19	5.075,06	1,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	4.208.082,55	16,05	0,90%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	3.558.602,39	3.625,77	0,76%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	3.481.722,02	67,44	0,74%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	3.295.537,00	65,41	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	3.194.774,23	63,58	0,68%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	2.935.531,06	2.954,44	0,63%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	2.398.174,69	477,75	0,51%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	2.264.004,19	5,48	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.218.501,79	4,67	0,47%
Debênture simples	HAPV11	HAPVIDA PARTICI	2.157.174,60	2.168,96	0,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.102.189,63	2,84	0,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	1.889.458,64	37,58	0,40%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	1.877.277,69	36,36	0,40%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	1.867.002,95	1.871,79	0,40%
Valores a receber	Valores a Receber	-	1.826.518,57	0,00	0,39%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Comercial P	COMPANHIA DE TR	1.831.582,00	1,22	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	1.815.108,51	35,54	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	1.787.840,84	35,34	0,38%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	1.755.640,96	34,33	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	1.676.353,33	33,11	0,36%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Comercial P	LOCALIZA	1.499.039,23	1,42	0,32%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	1.486.013,09	146,86	0,32%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU SA	1.337.854,25	1.357,48	0,29%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022	-	1.276.631,16	117,61	0,27%
Debênture simples	EKTR19	ELEKTRO S/A	1.249.300,77	1.246,37	0,27%
Debênture simples	SSED	SABER SERVIÇOS	1.265.968,47	125,73	0,27%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	1.277.299,12	1.259,37	0,27%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	1.256.455,83	1.259,37	0,27%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	1.282.291,56	141,78	0,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	1.183.427,27	4,47	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	1.172.640,61	22,95	0,25%
Debênture simples	Debêntures	REDE D'OR SAO L	1.173.007,51	1.171,82	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	1.157.041,50	22,75	0,25%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	1.108.265,57	222,22	0,24%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	1.097.298,78	1.080,62	0,23%

Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	1.029.625,94	3,66	0,22%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	1.006.360,84	1.004.752,63	0,21%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	942.454,20	919,14	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	940.400,84	3,45	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	928.933,75	17,87	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	927.751,81	18,28	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	921.901,18	17,87	0,20%
Debênture simples	ELEK18	ELEKTRO S/A	891.065,27	886,64	0,19%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022	-	885.859,16	81,66	0,19%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB	870.859,91	1.145,01	0,19%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	857.206,06	852,51	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	812.685,10	823,67	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	754.207,76	15,03	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	745.736,15	2,84	0,16%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	717.394,54	70,08	0,15%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	693.002,33	67,24	0,15%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	683.543,23	676,61	0,15%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	685.349,19	688,80	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	622.516,72	3,66	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	592.381,61	593,73	0,13%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	608.488,58	848,65	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	575.917,92	2,03	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	518.763,94	3,04	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO VOLKSWAGE	515.816,09	10,16	0,11%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	469.869,66	46,51	0,10%
Debênture simples	SBSPB3	SABESP	442.969,72	456,02	0,09%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	416.596,68	39,41	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	414.390,27	1,83	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	407.556,54	8,13	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	403.142,54	1,42	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	403.142,54	1,42	0,09%
Debênture simples	BRPRA6	BR PROPERTIES S	392.146,27	385,33	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RABOBANK	369.922,70	2,44	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	365.665,15	356,07	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	364.552,32	364,00	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	349.268,29	1,63	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	336.480,14	2,03	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A	336.288,54	326,83	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	333.260,16	1,83	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	334.654,14	323,58	0,07%
Debênture simples	SULM18	Sul América SA	329.888,04	325,41	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	322.988,94	318,50	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	324.848,87	6,30	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	317.913,70	1,42	0,07%
Debênture simples	CEEBO0	COELBA	295.450,10	29,66	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	290.203,67	286,61	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	289.906,56	0,61	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025	-	290.878,00	264,06	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	275.720,13	1,63	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	257.857,89	5,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	248.175,99	1,01	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	244.111,26	0,41	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	230.891,33	0,81	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	222.194,77	218,16	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	218.292,68	1,01	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	197.013,38	0,61	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	190.671,47	0,41	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	172.775,38	0,61	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	172.775,38	0,61	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	171.604,32	0,61	0,04%

Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	161.166,51	16,05	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	153.927,55	0,41	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	115.183,58	0,41	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	96.518,95	0,20	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	95.335,73	0,20	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	57.201,44	0,20	0,01%
Disponibilidades	Disponibilidade	-	5.835,22	0,00	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1V23	-	2.059,26	10,56	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1U21	-	-6,39	-1,63	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1J23	-	1.088,19	7,72	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1N24	-	898,31	4,67	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1N22	-	761,07	15,64	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25	-	701,38	3,25	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1J22	-	437,01	12,80	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1N23	-	402,82	2,44	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1V22	-	252,89	3,04	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F26	-	118,79	0,61	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F22	-	61,73	5,89	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1V21	-	2,77	1,01	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F24	-	-15.684,97	-79,42	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F23	-	-16.914,63	-144,42	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar	-	-439.105,62	0,00	-0,09%
Total			469.025.046,38		

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_06012016_15082026		7.468.477,13	1.695,27	9,28%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		7.449.284,66	1.851,96	9,25%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		5.310.689,76	1.302,24	6,60%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		19.814.863,85	4.382,89	24,61%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		11.846.005,53	2.685,01	14,71%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		10.574.571,90	2.490,02	13,13%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		9.450.088,65	2.099,61	11,74%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		8.322.226,64	2.013,43	10,34%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		284.539,62	347,32	0,35%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.938,01	-	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		1.402,33	-	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-10.770,69	-	-0,01%
Total			80.515.317,39		100,00%