

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			590.895,27	0,0070%
Total do Disponível			590.895,27	0,0070%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		150.684.282,99	1,79%
Financiamentos	Financiamentos		1.894.513,69	0,02%
Total Operações com Participantes			152.578.796,68	1,82%
<u>Fundos</u>				
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	1.530.142.638,8779	7.612.799.258,88	90,56%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	18.856.600,5715	490.615.724,26	5,84%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	31.268.245,8031	80.414.611,12	0,96%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	72.877,5283	7.957.398,91	0,09%
Sub-total			8.191.786.993,17	97,45%
<u>F.I.D.C.</u>				
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	6,0000	735.462,58	0,01%
Sub-total			735.462,58	0,01%
Total Renda Fixa			8.192.522.455,75	97,46%
Depósito Judiciais/Recursoais			2.763.627,47	0,03%
Total Depósito Judicial/Recursal			2.763.627,47	0,03%
<u>Imobiliário</u>				
Campinas	Imóveis		19.399.124,43	0,23%
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	28.096,0000	5.560.198,40	0,07%
RCRB 11 FII Rio Bravo Renda Corporativa	Cotas de Fundos	26.209,0000	4.492.222,60	0,05%
Total Imobiliário			29.451.545,43	0,35%
<u>Estruturados</u>				
<u>FIP's</u>				
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	12.135.958,7197	796.106,75	0,01%
FIP Brasil Energia Multiestrategia	Cotas de Fundos	390,2099	2.799.032,44	0,03%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	9.022,0000	630.752,41	0,01%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	5.319,8236	1.490.227,26	0,02%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	98,1548	702,00	0,00%
Infrabrasil FIP Multiestratégia _Senior B	Cotas de Fundos	2.034,1656	8.596.098,13	0,10%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	14.377,9918	11.304.582,49	0,13%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	150,0000	4.554.386,68	0,05%
FIP Multiestratégia Brasil Petroleo 1	Cotas de Fundos	15.994,8978	1.858.809,82	0,02%
Sub-total			32.030.697,98	0,38%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			394.809,99	0,005%
Total Exigível Operacional			394.809,99	0,005%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			568.267,32	0,007%
Total Exigível Contingencial			568.267,32	0,007%
Total Plano II			8.406.211.313,80	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA II - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA			QT de Cotas	1530142639
Renda Fixa				

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		626.194.817,26	141.341,00	8,23%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		341.921.533,53	79.242,00	4,49%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		315.149.649,32	68.993,00	4,14%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		2.598.450.055,01	317.082,00	34,13%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		238.687.223,81	50.790,00	3,14%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.422.161.552,40	299.635,00	18,68%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		850.699.085,27	186.394,00	11,17%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		841.757.060,48	210.466,00	11,06%
Títulos Públicos	NTNB_14012009_15082020		80.020.668,88	23.509,00	1,05%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		65.251.586,71	15.769,00	0,86%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		65.225.179,34	15.370,00	0,86%
Títulos Públicos	NTNB_15032002_15032023		63.922.869,69	16.653,00	0,84%
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025		45.294.635,16	38.731,00	0,59%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		35.912.680,18	9.522,00	0,47%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		ITAU UNIBANCO S	16.736.490,67	23,00	0,22%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		SAFRA S/A	6.483.199,95	6,00	0,09%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		3.244.494,13	846,00	0,04%
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB	2.573.316,94	5.000,00	0,03%
Debênture simples	RDCO24	ROD DAS COLINAS	1.005.035,67	300,00	0,01%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.449,72		0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		16.556,43		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-7.917.881,67		-0,10%
Total			7.612.799.258,88		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	18856601
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Valores a receber	Valores a Receber		6.593,92	0,00	0,00%
Disponibilidades	Disponibilidade		2.917,36	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-1.709.835,42	0,00	-0,35%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		164.331.540,38	15.407,55	33,49%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		41.315.843,32	10.954,61	8,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	11.994.778,25	57,19	2,44%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	8.334.485,24	49,24	1,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	6.503.140,95	38,42	1,33%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	6.378.147,57	125,63	1,30%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	6.335.723,96	125,63	1,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	6.211.716,05	6,18	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	4.471.556,11	17,44	0,91%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	4.438.638,22	26,05	0,90%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participaçõ	9.116.995,41	892,23	1,86%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	3.689.456,62	73,30	0,75%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	3.436.876,77	16,12	0,70%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	5.246.529,50	519,31	1,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	2.359.159,40	5,96	0,48%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	3.857.583,41	387,72	0,79%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.331.614,76	5,08	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.206.354,99	3,09	0,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	1.989.076,25	39,52	0,41%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	3.060.162,28	3.211,47	0,62%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	1.746.232,46	1.781,38	0,36%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	3.032.058,46	3.157,82	0,62%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	4.904.279,21	4.936,99	1,00%
	Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note				
Títulos de Crédito Privado	LOCALIZA		1.579.682,20	1,55	0,32%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	2.397.113,02	241,55	0,49%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	1.437.991,67	1.475,58	0,29%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	1.620.879,48	159,64	0,33%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	1.624.123,25	163,17	0,33%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		1.364.215,34	127,84	0,28%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	1.274.343,42	3.177,25	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	1.261.378,74	4,86	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	1.201.309,03	3,97	0,24%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	1.171.234,85	1.244,62	0,24%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	2.145.872,00	2.142,16	0,44%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	1.365.943,36	1.368,93	0,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	999.443,18	3,75	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	987.604,71	19,43	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	977.213,46	19,43	0,20%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		947.016,23	88,76	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	893.435,88	5,52	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	848.443,48	895,33	0,17%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	1.054.112,06	1.092.163,02	0,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	792.427,66	3,09	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	782.204,96	758,21	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	781.911,66	757,99	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	698.127,04	4,20	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	661.994,28	3,97	0,13%
Debênture simples	LAMEA2	LOJAS AMERICANA	944.385,04	97,37	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	631.785,74	2,21	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	620.388,38	3,75	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	602.686,46	2,65	0,12%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	1.308.002,80	1.368,93	0,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	552.462,59	2,43	0,11%

Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	551.661,90	3,31	0,11%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	1.151.147,88	113,93	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	524.179,41	2,43	0,11%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	1.531.678,20	154,12	0,31%
Debênture simples	SBSPB3	SABESP	464.536,06	495,69	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	442.250,02	1,55	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	440.886,70	1,99	0,09%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	1.586.598,78	1.669,88	0,32%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	431.488,47	429,67	0,09%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	730.724,06	748,72	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	401.790,98	1,77	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	394.586,05	395,67	0,08%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	753.287,08	922,48	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	358.115,91	2,21	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	353.959,71	1,99	0,07%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		343.482,41	287,03	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	344.109,26	6,84	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	337.658,14	1,55	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	329.347,31	317,95	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	329.342,55	317,95	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	324.275,05	1,99	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	317.608,44	32,24	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	309.196,19	1,32	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	304.700,13	0,66	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	303.665,66	311,54	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	293.306,11	1,77	0,06%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	498.741,81	50,56	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	263.843,52	1,10	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	259.849,81	0,44	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	257.663,49	1,10	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	256.876,96	251,27	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	256.876,89	251,27	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	231.415,23	1,10	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	222.801,83	0,44	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	200.218,17	0,66	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	189.535,72	0,66	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	178.639,90	1,10	0,04%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	169.128,35	17,44	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	163.354,39	0,44	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	149.497,49	0,88	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	126.357,15	0,44	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	111.434,67	0,22	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	66.840,55	0,22	0,01%
Operações Compromissadas	LFT_14072017_01092023		25.869,92	2,43	0,01%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F23		340,00	64,03	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22		-55,72	-1,99	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		-286,77	-3,75	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F22		-7.488,34	-301,83	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		24.218.901,94	5.102,68	4,94%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		13.667.863,31	3.417,40	2,79%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		13.657.619,38	2.992,48	2,78%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		12.518.919,48	3.264,30	2,55%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		12.218.137,09	2.757,81	2,49%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		9.632.704,08	2.739,91	1,96%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		7.945.695,79	1.739,48	1,62%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		7.940.632,00	1.652,40	1,62%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		6.946.052,70	8.267,51	1,42%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		6.705.517,30	1.554,04	1,37%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		6.338.824,05	1.531,87	1,29%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		4.600.084,43	1.150,22	0,94%

Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	3.674.716,78	865,93	0,75%
Títulos Públicos	NTNB_14012009_15082020	2.574.711,27	756,42	0,52%
Operações Compromissadas	NTNB_13102011_15082022	1.580.949,75	374,59	0,32%
Total		490.615.724,26		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		27.391.657,59	5.771,14	34,06%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		18.643.871,91	4.085,00	23,18%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		12.008.114,98	2.710,40	14,93%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		7.494.602,71	1.766,07	9,32%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		5.758.832,06	1.334,64	7,16%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		4.267.666,21	888,08	5,31%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		2.311.821,82	558,69	2,87%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		1.550.689,30	339,48	1,93%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		994.112,15	850,06	1,24%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.515,67	-	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		2.333,69	-	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-12.606,97	-	-0,02%
Total			80.414.611,12		100,00%