

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			536.429,58	0,0065%
Total do Disponível			536.429,58	0,0065%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		149.391.446,81	1,80%
Financiamentos	Financiamentos		1.866.322,12	0,02%
Total Operações com Participantes			151.257.768,93	1,82%
<u>Fundos</u>				
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	1.522.404.339,9837	7.526.150.407,00	90,52%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	18.856.600,5715	488.518.236,50	5,88%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	31.268.245,8031	77.479.068,48	0,93%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	72.877,5283	7.857.761,92	0,09%
Sub-total			8.100.005.473,90	97,42%
<u>F.I.D.C.</u>				
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	6,0000	522.643,47	0,01%
Sub-total			522.643,47	0,01%
Total Renda Fixa			8.100.528.117,37	97,43%
Depósito Judiciais/Recursois			2.763.627,47	0,03%
Total Depósito Judicial/Recursal			2.763.627,47	0,03%
<u>Imobiliário</u>				
Campinas	Imóveis		19.363.050,75	0,23%
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	28.096,0000	5.393.870,08	0,06%
RCRB 11 FII Rio Bravo Renda Corporativa	Cotas de Fundos	26.209,0000	4.633.227,02	0,06%
Total Imobiliário			29.390.147,85	0,35%
<u>Estruturados</u>				
<u>FIP's</u>				
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	12.135.958,7197	793.351,90	0,01%
FIP Brasil Energia Multiestratégia	Cotas de Fundos	390,2099	2.771.939,84	0,03%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	9.022,0000	632.726,86	0,01%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	5.319,8236	1.488.098,46	0,02%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	98,1548	178,00	0,00%
Infrabrasil FIP Multiestratégia _Senior B	Cotas de Fundos	2.034,1656	7.486.119,36	0,09%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	14.377,9918	11.293.294,12	0,14%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	150,0000	4.550.193,55	0,05%
FIP Multiestratégia Brasil Petroleo 1	Cotas de Fundos	15.994,8978	1.855.927,08	0,02%
Sub-total			30.871.829,17	0,37%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			250.641,69	0,003%
Total Exigível Operacional			250.641,69	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			570.767,70	0,007%
Total Exigível Contingencial			570.767,70	0,007%
Total Plano II			8.314.526.510,98	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA II - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas 1522404340
Renda Fixa	

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		607.960.659,78	141.341,00	8,08%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		327.713.313,97	75.913,00	4,35%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		327.572.574,43	79.242,00	4,35%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		2.644.461.944,20	317.082,00	35,14%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		245.615.301,46	50.790,00	3,26%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.327.536.928,48	299.635,00	17,64%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		855.684.450,83	195.504,00	11,37%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		819.331.125,88	210.466,00	10,89%
Operações Compromissadas	LFT_06092019_01032026		124.116.753,35	11.658,00	1,65%
Títulos Públicos	NTNB_15032002_15032023		64.340.575,54	16.653,00	0,85%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		62.832.105,42	15.769,00	0,83%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		62.628.957,46	15.370,00	0,83%
Valores a receber	Valores a Receber		29.525.774,75		0,39%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		ITAU UNIBANCO S	16.924.132,29	23,00	0,22%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		SAFRA S/A	6.558.249,06	6,00	0,09%
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB	2.596.881,43	5.000,00	0,03%
Debênture simples	RDCO24	ROD DAS COLINAS	1.008.728,05	300,00	0,01%
Disponibilidades	Disponibilidade		22.249,72		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-280.299,10		0,00%
Total			7.526.150.407,00		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO			QT de Cotas	18856601	
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		10.954,26	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		3.972,61	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-530.725,98	0,00	-0,11%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		164.041.041,16	15.355,69	33,58%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		41.240.737,01	11.129,71	8,44%
Operações Compromissadas	NTNF_10012014_01012025		21.085.609,27	18.310,40	4,32%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	11.974.661,56	56,99	2,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	6.371.069,39	125,21	1,30%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	6.324.191,57	125,21	1,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	6.209.737,46	6,16	1,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	4.473.456,32	17,38	0,92%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	4.431.383,56	25,97	0,91%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participaçõ	9.111.477,82	889,23	1,87%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	3.671.622,61	73,06	0,75%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	3.431.497,88	16,06	0,70%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	5.149.237,57	517,56	1,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	2.384.080,91	5,94	0,49%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	3.863.839,22	386,41	0,79%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.326.136,24	5,06	0,48%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.199.205,40	3,08	0,45%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	1.979.587,81	39,39	0,41%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	3.071.499,47	3.200,66	0,63%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	1.770.104,95	1.775,38	0,36%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	3.066.847,09	3.147,19	0,63%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	4.840.017,96	4.920,37	0,99%
	Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note				
Títulos de Crédito Privado	LOCALIZA	LOCALIZA	1.578.491,49	1,54	0,32%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	2.400.528,34	240,74	0,49%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	1.433.021,22	1.470,61	0,29%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	1.628.076,14	159,10	0,33%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	1.607.550,13	162,62	0,33%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		1.361.825,53	127,41	0,28%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	1.273.082,88	3.166,55	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	1.259.282,66	4,84	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	1.191.154,76	3,96	0,24%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	1.154.415,00	1.240,43	0,24%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	2.143.768,79	2.134,95	0,44%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	1.363.413,81	1.364,32	0,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	997.926,19	3,74	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	985.192,00	19,36	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	975.454,47	19,36	0,20%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		945.359,15	88,46	0,19%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		893.365,65	1.075,18	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	891.957,42	5,50	0,18%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	852.824,19	892,31	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	792.764,41	3,08	0,16%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	1.049.960,91	1.088.486,81	0,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	780.430,42	755,66	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	780.146,38	755,44	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	660.833,63	3,96	0,14%
Debênture simples	LAMEA2	LOJAS AMERICANA	951.318,00	97,04	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	627.723,11	2,20	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	619.425,49	3,74	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	601.666,84	2,64	0,12%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	1.324.757,69	1.364,32	0,27%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	551.527,94	2,42	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	550.694,69	3,30	0,11%

Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	1.154.148,63	113,55	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	523.329,59	2,42	0,11%
Debênture simples	SBSBP3	SABESP	478.829,35	494,02	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	440.483,45	1,98	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	439.406,18	1,54	0,09%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	1.590.388,19	1.664,26	0,33%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	433.604,58	428,22	0,09%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	1.424.966,42	153,60	0,29%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	731.526,61	746,20	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	401.111,23	1,76	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	394.093,42	394,33	0,08%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	754.801,89	919,38	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	357.548,67	2,20	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	354.008,36	1,98	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	342.837,73	6,82	0,07%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		335.681,36	286,07	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	336.944,26	1,54	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	328.896,05	316,88	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	328.891,31	316,88	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	323.760,86	1,98	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	316.592,44	32,13	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	308.729,62	1,32	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	303.986,66	0,66	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	302.832,01	310,49	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	293.080,33	1,76	0,06%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	498.433,07	50,39	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	263.278,05	1,10	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	259.454,14	0,44	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	257.274,68	1,10	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	256.409,56	250,42	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	256.407,80	250,42	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	230.033,63	1,10	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	220.921,09	0,44	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	198.525,79	0,66	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	188.316,93	0,66	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	178.344,28	1,10	0,04%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	170.693,46	17,38	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	161.986,70	0,44	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	125.544,62	0,44	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	110.494,26	0,22	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	66.276,33	0,22	0,01%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F24		1.875,48	15,18	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22		-77,63	-1,98	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F22		-1.602,57	-78,56	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1J23		1.555,01	22,45	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1V23		1.099,98	10,56	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		673,36	3,74	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1N23		378,58	4,40	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		23.524.747,89	5.309,71	4,82%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		13.845.625,55	3.556,60	2,83%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		13.628.765,10	3.113,86	2,79%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		13.114.876,39	3.396,70	2,68%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		12.338.914,51	2.868,60	2,53%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		9.902.314,76	2.797,22	2,03%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		7.856.584,37	1.819,93	1,61%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		7.831.170,11	1.722,50	1,60%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		6.853.658,63	1.657,95	1,40%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		6.343.088,59	1.591,93	1,30%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		6.199.501,13	1.560,17	1,27%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		3.676.704,80	902,31	0,75%

Operações Compromissadas	NTNB_13102011_15082022	226.326,45	56,87	0,05%
Total		488.518.236,50		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		22.208.617,78	5.012,65	28,66%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		12.869.890,34	2.940,47	16,61%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		11.658.450,82	2.710,40	15,05%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		7.397.790,74	1.627,17	9,55%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		7.394.581,23	1.712,91	9,54%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		6.457.000,52	1.561,99	8,33%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		5.982.646,86	1.501,47	7,72%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		3.465.347,66	850,44	4,47%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		50.039,30	43,45	0,06%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.736,19	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		1.352,82	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-10.385,77	0,00	-0,01%
Total			77.479.068,48		100,00%