

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			779.202,26	0,0096%
Total do Disponível			779.202,26	0,0096%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		149.061.966,23	1,83%
Financiamentos	Financiamentos		1.842.414,42	0,02%
Total Operações com Participantes			150.904.380,65	1,85%
<u>Fundos</u>				
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	1.500.234.866,9099	7.305.602.592,17	89,54%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	21.678.358,0907	556.045.688,09	6,82%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	29.829.088,5881	75.454.885,13	0,92%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	72.877,5283	7.804.037,36	0,10%
Sub-total			7.944.907.202,75	97,38%
<u>F.I.D.C.</u>				
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	6,0000	119.895,55	0,00%
Sub-total			119.895,55	0,00%
Total Renda Fixa			7.945.027.098,30	97,38%
Depósito Judiciais/Recursoais			2.763.627,47	0,03%
Total Depósito Judicial/Recursoal			2.763.627,47	0,03%
<u>Imobiliário</u>				
Campinas	Imóveis		19.326.977,07	0,24%
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	28.096,0000	5.314.358,40	0,07%
RCRB 11 FII Rio Bravo Renda Corporativa	Cotas de Fundos	26.209,0000	4.638.468,82	0,06%
Total Imobiliário			29.279.804,29	0,36%
<u>Estruturados</u>				
<u>FIP's</u>				
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	12.135.958,7197	849.092,34	0,01%
FIP Brasil Energia Multiestrategia	Cotas de Fundos	390,2099	2.742.050,13	0,03%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	9.022,0000	624.568,26	0,01%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	5.319,8236	1.484.205,38	0,02%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	98,2561	8.459,86	0,00%
Infrabrasil FIP Multiestratégia _Senior B	Cotas de Fundos	2.034,1656	7.464.672,20	0,09%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	14.377,9918	11.282.000,74	0,14%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	150,0000	4.545.648,30	0,06%
FIP Multiestratégia Brasil Petroleo 1	Cotas de Fundos	15.994,8978	1.853.127,02	0,02%
Sub-total			30.853.824,23	0,38%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			272.496,54	0,003%
Total Exigível Operacional			272.496,54	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			572.822,47	0,007%
Total Exigível Contingencial			572.822,47	0,007%
Total Plano II			8.158.762.618,19	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA II - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas	1500234867
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		592.829.419,53	141.341,00	8,11%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		321.341.250,36	79.242,00	4,40%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		318.233.226,91	75.913,00	4,36%
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		2.703.696.386,48	317.082,00	37,01%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		256.864.795,47	50.790,00	3,52%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.285.077.285,33	299.635,00	17,59%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		833.040.324,37	195.504,00	11,40%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		813.159.168,77	210.466,00	11,13%
Títulos Públicos	NTNB_15032002_15032023		62.548.736,64	16.653,00	0,86%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		62.264.911,38	15.769,00	0,85%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		61.836.020,90	15.370,00	0,85%
<a href="#_self" onclick="CallA	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO S	16.910.342,15	23,00	0,23%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		16.010.009,49	19.639,00	0,22%
<a href="#_self" onclick="CallA	Letra Financeira	SAFRA S/A	6.604.655,72	6,00	0,09%
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB	2.618.310,78	5.000,00	0,04%
Debênture simples	RDCO24	ROD DAS COLINAS	1.013.486,62	300,00	0,01%
Valores a receber	Valores a Receber		5.624,60		0,00%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.223,94		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-48.460.587,27		-0,66%
Total			7.305.602.592,17		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	21555943
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		4.792,48	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		155.781,50	0,00	0,03%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-273.585,29	0,00	-0,05%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		164.630.085,97	15.443,42	29,61%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		89.721.847,29	110.059,11	16,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	12.063.711,98	57,32	2,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	6.420.752,26	125,93	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	6.370.146,60	125,93	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	6.264.068,79	6,20	1,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	4.508.736,53	17,48	0,81%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participaçõ	9.180.317,82	894,31	1,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	3.704.176,90	73,47	0,67%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	3.457.219,59	16,16	0,62%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	5.193.926,28	520,52	0,93%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	2.406.115,08	5,98	0,43%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	3.900.209,21	388,62	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.341.414,79	5,09	0,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.211.706,64	3,10	0,40%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	1.996.832,99	39,61	0,36%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	1.939.954,15	38,73	0,35%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	3.103.310,22	3.218,95	0,56%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	1.786.030,72	1.785,53	0,32%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	3.111.771,22	3.165,17	0,56%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	4.880.748,34	4.948,48	0,88%
Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note					
Títulos de Crédito Privado	LOCALIZA		1.594.053,45	1,55	0,29%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	2.433.286,40	242,11	0,44%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	1.440.122,83	1.479,01	0,26%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	1.607.759,72	160,01	0,29%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	1.622.456,64	163,55	0,29%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		1.370.273,91	128,14	0,25%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	1.283.376,33	3.184,64	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	1.268.811,17	4,87	0,23%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	1.140.449,69	1.247,52	0,21%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	2.160.899,94	2.147,15	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	1.083.471,53	3,98	0,19%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	1.354.220,22	1.372,12	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	1.005.370,51	3,76	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	992.646,14	19,48	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	982.573,26	19,48	0,18%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		950.333,84	88,97	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	898.792,00	5,53	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	861.754,43	897,41	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	799.016,60	3,10	0,14%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	1.055.288,68	1.094.705,75	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	786.789,89	759,98	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	786.503,19	759,76	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	665.694,34	3,98	0,12%
Debênture simples	LAMEA2	LOJAS AMERICANA	973.955,34	97,60	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	629.414,05	2,21	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	624.072,66	3,76	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	606.364,03	2,66	0,11%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	1.321.394,34	1.372,12	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	555.833,69	2,43	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	554.745,28	3,32	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	527.344,78	2,43	0,09%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	1.144.292,95	114,20	0,21%

Debênture simples	SBSPB3	SABESP	484.035,31	496,84	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	443.881,60	1,99	0,08%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	1.607.710,63	1.673,76	0,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	440.589,83	1,55	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	440.589,83	1,55	0,08%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	1.438.496,53	154,47	0,26%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	737.877,11	750,46	0,13%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	429.259,61	430,67	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	404.242,68	1,77	0,07%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	391.583,02	396,59	0,07%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	763.615,69	924,63	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	360.228,52	2,21	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	356.656,57	1,99	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	345.881,22	6,86	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	339.527,84	1,55	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		333.282,70	287,70	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	326.247,60	1,99	0,06%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	319.879,07	32,31	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	311.067,38	1,33	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	305.986,72	0,66	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	299.427,33	312,27	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	295.325,14	1,77	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	503.718,08	50,68	0,09%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	265.355,56	1,11	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	261.382,43	0,44	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	259.222,82	1,11	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	258.411,17	251,85	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	258.409,39	251,85	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	243.230,28	0,89	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	231.265,76	1,11	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	200.642,88	0,44	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	188.824,21	0,66	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	180.578,59	0,66	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	179.710,84	1,11	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	172.694,82	17,48	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	162.153,52	0,44	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	125.882,81	0,44	0,02%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F22		116.567,28	640,47	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	100.321,44	0,22	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	60.192,86	0,22	0,01%
Operações Compromissadas	LFT_14072017_01092023		11.808,52	1,11	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22		395,07	1,99	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		-1.340,39	-3,54	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		26.121.655,08	6.112,78	4,70%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		23.362.308,97	6.302,51	4,20%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		15.824.912,91	4.106,94	2,85%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		15.281.821,87	3.586,45	2,75%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		15.063.679,24	3.923,68	2,71%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		13.842.372,55	3.300,27	2,49%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		11.510.262,30	3.225,28	2,07%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		8.851.387,47	2.111,46	1,59%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		8.847.344,50	2.010,75	1,59%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		8.794.801,38	2.232,51	1,58%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		7.946.093,31	1.981,61	1,43%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		7.273.585,35	1.842,08	1,31%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		4.209.209,39	1.046,24	0,76%
Total			556.045.688,09		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		21.498.302,36	5.012,65	28%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		12.529.312,20	2.940,47	17%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		11.368.289,26	2.710,40	15%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		7.180.670,86	1.712,91	10%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		7.159.583,35	1.627,17	9%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		6.334.170,76	1.561,99	8%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		5.928.640,69	1.501,47	8%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		3.421.473,37	850,44	5%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		41.116,91	50,44	0%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.697,37	0,00	0%
Valores a receber	Valores a Receber		71,59	0,00	0%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-10.443,60	0,00	0%
Total			75.454.885,13		100%