

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			598.054,25	0,0072%
Total do Disponível			598.054,25	0,0072%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		148.016.009,48	1,79%
Financiamentos	Financiamentos		1.691.876,99	0,02%
Total Operações com Participantes			149.707.886,47	1,81%
<u>Fundos</u>				
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	1.496.161.021,8586	7.426.246.505,62	89,89%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	20.898.734,4396	539.821.108,31	6,53%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	31.268.245,8031	75.611.215,73	0,92%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	72.877,5283	7.826.802,56	0,09%
Sub-total			8.049.505.632,22	97,44%
<u>F.I.D.C.</u>				
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	6,0000	106.887,42	0,00%
Sub-total			106.887,42	0,00%
Total Renda Fixa			8.049.612.519,64	97,44%
Depósito Judiciais/Recursois			2.763.627,47	0,03%
Total Depósito Judicial/Recursal			2.763.627,47	0,03%
<u>Imobiliário</u>				
Campinas	Imóveis		19.290.903,39	0,23%
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	28.096,0000	5.613.580,80	0,07%
RCRB 11 FII Rio Bravo Renda Corporativa	Cotas de Fundos	26.209,0000	4.494.319,32	0,05%
Total Imobiliário			29.398.803,51	0,36%
<u>Estruturados</u>				
<u>FIP's</u>				
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	12.135.958,7197	844.650,59	0,01%
FIP Brasil Energia Multiestrategia	Cotas de Fundos	390,2099	1.361.633,23	0,02%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	9.022,0000	640.951,20	0,01%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	5.319,8236	1.480.484,70	0,02%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	98,2561	6.376,76	0,00%
Infrabrasil FIP Multiestratégia _Senior B	Cotas de Fundos	2.034,1656	7.870.797,99	0,10%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	14.377,9918	11.270.732,69	0,14%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	150,0000	4.541.508,55	0,05%
FIP Multiestratégia Brasil Petroleo 1	Cotas de Fundos	15.994,8978	1.850.287,32	0,02%
Sub-total			29.867.423,03	0,36%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			286.883,26	0,003%
Total Exigível Operacional			286.883,26	0,003%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			577.806,02	0,007%
Total Exigível Contingencial			577.806,02	0,007%
Total Plano II			8.261.083.625,09	100,00%

* Fundo exclusivo

MARBELLA II - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas	1496161022
Renda Fixa		

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		2.774.651.362,63	317.195,20	37,36%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.290.440.196,16	299.741,97	17,38%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		835.908.571,62	195.573,79	11,26%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		812.104.927,65	210.541,14	10,94%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		592.949.206,73	141.391,46	7,98%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		321.996.971,61	79.270,29	4,34%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		320.106.781,16	75.940,10	4,31%
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		258.170.484,60	50.808,13	3,48%
Títulos Públicos	NTNB_15032002_15032023		62.383.496,75	16.658,95	0,84%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		62.044.927,92	15.774,63	0,84%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		61.610.344,34	15.375,49	0,83%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		ITAU UNIBANCO S	16.894.864,99	23,01	0,23%
Valores a receber	Valores a Receber		6.871.462,01		0,09%
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		SAFRA S/A	6.648.760,04	6,00	0,09%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		3.720.791,72	4.573,63	0,05%
Disponibilidades	Disponibilidade		9.156,87		0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-265.801,17		0,00%
Total			7.426.246.505,62		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	20898734
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		4.691,91	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		3.979,88	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-302.101,25	0,00	-0,06%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		160.022.183,02	15.011,17	29,64%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		87.787.021,61	107.687,72	16,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	11.726.055,50	55,71	2,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	6.241.039,04	122,40	1,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	6.191.849,80	122,40	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	6.088.741,05	6,02	1,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	4.382.539,55	16,99	0,81%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participaçõ	8.923.365,92	869,28	1,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	3.600.499,09	71,42	0,67%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	3.360.453,97	15,70	0,62%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	5.048.551,22	505,95	0,94%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	2.338.769,28	5,81	0,43%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	3.791.044,56	377,74	0,70%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.275.879,91	4,95	0,42%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.149.802,23	3,01	0,40%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	1.940.942,77	38,51	0,36%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	1.885.655,93	37,65	0,35%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	3.016.450,32	3.128,85	0,56%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	1.736.040,73	1.735,55	0,32%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	3.024.674,50	3.076,58	0,56%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	4.744.138,96	4.809,98	0,88%
Nota Promissória/ Commercial Paper/ Export Note					
Títulos de Crédito Privado	LOCALIZA		1.549.436,79	1,51	0,29%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	2.365.180,09	235,34	0,44%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	1.399.814,61	1.437,62	0,26%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	1.562.759,44	155,53	0,29%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	1.577.045,00	158,97	0,29%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		1.331.920,72	124,55	0,25%
Debênture simples	EGIE18	ENGIE BRASIL EN	1.247.455,35	3.095,51	0,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	1.233.297,86	4,73	0,23%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	1.108.529,15	1.212,60	0,21%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	2.100.417,57	2.087,05	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	1.053.145,77	3,87	0,20%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	1.316.316,36	1.333,71	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	977.230,76	3,66	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	964.862,54	18,93	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	955.071,59	18,93	0,18%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		923.734,53	86,48	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	873.635,32	5,38	0,16%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	837.634,41	872,29	0,16%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	776.652,58	3,01	0,14%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	1.025.751,75	1.064.065,55	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	764.489,41	738,49	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	764.768,08	738,71	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	647.061,93	3,87	0,12%
Debênture simples	LAMEA2	LOJAS AMERICANA	946.694,88	94,87	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	611.797,10	2,15	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO RCI BRASI	606.605,22	3,66	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	589.392,24	2,58	0,11%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	1.284.409,26	1.333,71	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	540.276,22	2,37	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	539.218,28	3,23	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	512.584,70	2,37	0,09%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	1.112.264,84	111,00	0,21%

Debênture simples	SBSPB3	SABESP	470.487,44	482,93	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	431.457,61	1,94	0,08%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	1.562.711,72	1.626,92	0,29%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	428.257,97	1,51	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	428.257,97	1,51	0,08%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	1.398.233,83	150,15	0,26%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	717.224,34	729,46	0,13%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	417.244,88	418,61	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	392.928,16	1,72	0,07%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	380.622,83	385,49	0,07%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	742.242,52	898,75	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	350.145,93	2,15	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	346.673,95	1,94	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	336.200,20	6,67	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	330.024,65	1,51	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		323.954,31	279,65	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	317.116,12	1,94	0,06%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	310.925,84	31,41	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	302.360,78	1,29	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	297.422,32	0,65	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	291.046,53	303,53	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	287.059,15	1,72	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	257.928,41	1,08	0,05%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	489.619,29	49,26	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	254.066,48	0,43	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	251.967,32	1,08	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	251.178,39	244,80	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	251.176,66	244,80	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	236.422,41	0,86	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	224.792,76	1,08	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	195.027,00	0,43	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	183.539,13	0,65	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	175.524,30	0,65	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	174.680,83	1,08	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	167.861,19	16,99	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	157.614,94	0,43	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	122.359,42	0,43	0,02%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F22		113.304,63	622,54	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	97.513,50	0,22	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	58.508,10	0,22	0,01%
Operações Compromissadas	LFT_14072017_01092023		11.478,01	1,08	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22		384,01	1,94	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		-1.302,88	-3,44	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		25.372.375,87	5.893,47	4,70%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		22.628.941,02	6.062,76	4,19%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		15.214.695,85	3.944,46	2,82%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		14.763.688,26	3.454,19	2,73%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		14.456.214,00	3.768,09	2,68%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		13.341.899,87	3.181,44	2,47%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		10.797.416,36	2.997,93	2,00%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		8.864.565,59	2.249,65	1,64%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		8.542.069,39	1.932,45	1,58%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		8.520.637,29	2.021,38	1,58%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		7.735.708,05	1.904,40	1,43%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		6.962.277,66	1.770,13	1,29%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		4.002.652,31	998,90	0,74%
Total			539.821.108,31		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		21.580.315,32	5.012,65	28,54%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		12.567.965,20	2.940,47	16,62%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		11.366.528,48	2.710,40	15,03%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		7.220.368,40	1.712,91	9,55%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		7.192.638,58	1.627,17	9,51%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		6.344.831,01	1.561,99	8,39%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		5.905.586,35	1.501,47	7,81%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		3.407.769,80	850,44	4,51%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		29.038,01	35,69	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.755,60	-	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		2.550,36	-	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-10.131,38	-	-0,01%
Total			75.611.215,73		100,00%