

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			898.553,73	0,011%
Total do Disponível			898.553,73	0,011%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		147.838.392,41	1,77%
Financiamentos	Financiamentos		1.368.385,19	0,02%
Total Operações com Participantes			149.206.777,60	1,79%
<u>Fundos</u>				
*Marbella II - FI RF	Cotas de Fundos	1.489.028.823,2810	7.518.736.566,62	90,04%
*Hermes FIC de FI MM	Cotas de Fundos	20.756.953,6639	537.094.291,56	6,43%
*Quiron - FI RF IMA-B 5+	Cotas de Fundos	31.268.245,8031	77.555.171,64	0,93%
Vinci FI RF Imobiliário Crédito Privado II	Cotas de Fundos	72.877,5283	7.967.414,79	0,10%
Sub-total			8.141.353.444,61	97,50%
<u>F.I.D.C.</u>				
Eco Multi Commodities FIDC Financ. Agrop. Senior 1	Cotas de Fundos	6,0000	177.579,25	0,00%
Sub-total			177.579,25	0,00%
Total Renda Fixa			8.141.531.023,86	97,50%
Depósito Judiciais/Recursois			2.763.627,47	0,03%
Total Depósito Judicial/Recursal			2.763.627,47	0,03%
<u>Imobiliário</u>				
Campinas	Imóveis		19.254.829,71	0,23%
FIIP11B RB Capital	Cotas de Fundos	28.096,0000	5.675.392,00	0,07%
RCRB 11 FII Rio Bravo Renda Corporativa	Cotas de Fundos	26.209,0000	4.455.530,00	0,05%
Total Imobiliário			29.385.751,71	0,35%
<u>Estruturados</u>				
<u>FIP's</u>				
Brasil Mezanino Infraestrutura FIP	Cotas de Fundos	12.135.958,7197	840.900,58	0,01%
FIP Brasil Energia Multiestrategia	Cotas de Fundos	390,2099	1.202.977,07	0,01%
FIP Multiestratégia Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	9.022,0000	17.001,42	0,00%
Investidores Institucionais III - FIP	Cotas de Fundos	5.319,8236	1.477.058,97	0,02%
FIP Terra Viva Multiestratégia	Cotas de Fundos	98,2561	3.885,36	0,00%
Infrabrasil FIP Multiestratégia _Senior B	Cotas de Fundos	2.034,1656	5.748.359,38	0,07%
Fdo Brasil de Internacionalização de Empresas FIP	Cotas de Fundos	14.377,9918	11.942.238,39	0,14%
Brasil Energia Renovável FIP	Cotas de Fundos	150,0000	4.536.673,72	0,05%
FIP Multiestratégia Brasil Petroleo 1	Cotas de Fundos	15.994,8978	1.849.701,38	0,02%
Sub-total			27.618.796,27	0,33%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			410.083,35	0,005%
Total Exigível Operacional			410.083,35	0,005%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			582.948,49	0,007%
Total Exigível Contingencial			582.948,49	0,007%
Total Plano II			8.350.411.498,80	100,00%

*Fundo exclusivo

MARBELLA II - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA			QT de Cotas	1489028823
Renda Fixa				

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		2.814.497.692,58	317.194,84	37,45
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.328.229.481,46	299.741,63	17,67
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		838.498.074,23	195.573,57	11,16
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		824.901.157,32	210.540,90	10,97
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		594.080.509,65	141.391,30	7,90
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		361.626.821,37	86.901,91	4,81
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		337.591.031,32	78.525,93	4,49
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		266.158.516,89	50.808,07	3,54
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		63.105.913,47	15.774,61	0,84
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		62.889.608,32	15.375,47	0,84
Títulos Públicos	NTNB_15032002_15032023		20.547.898,10	5.415,93	0,27
Depósitos a prazo e outros títul Letra Financeira		ITAU UNIBANCO S	17.145.208,08	23,01	0,23
Depósitos a prazo e outros títul Letra Financeira		SAFRA S/A	6.734.082,89	6,00	0,09
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		1.421.452,21	1.735,62	0,02
Disponibilidades	Disponibilidade		4.621,82		0,00
Valores a receber	Valores a Receber		11.555,40		0,00
Valores a pagar	Valores a Pagar		-18.707.049,48		-0,25
Total			7.518.736.575,63		100,03

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		22.169.318,73	5.002,95	28,59%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		12.606.913,00	2.940,47	16,26%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		11.339.323,46	2.698,76	14,62%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		7.475.439,15	1.677,61	9,64%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		7.363.994,25	1.712,91	9,50%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		7.089.239,94	1.703,60	9,14%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		6.006.580,39	1.501,47	7,74%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		3.478.531,97	850,44	4,49%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		30.821,58	37,63	0,04%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.764,21	-	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		1.299,28	-	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-10.054,31	-	-0,01%
TOTAL			77.555.171,64		100,00%

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO				QT de Cotas	20634539
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		7.397,66	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		197.174,48	0,00	0,04%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-374.389,78	0,00	-0,07%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		159.867.118,93	14.949,89	29,77%
Operações Compromissadas	NTNF_15012016_01012027		74.430.165,29	65.498,66	13,86%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	11.899.266,31	56,32	2,22%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	6.334.011,88	123,72	1,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	6.283.232,07	123,72	1,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	6.190.875,10	6,09	1,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO C6 S.A	6.111.772,71	6,09	1,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	4.452.200,50	17,18	0,83%
Debênture simples	NCFP13	NCF Participaçõ	9.051.506,84	878,68	1,69%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	3.661.608,32	72,19	0,68%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	3.408.180,63	15,87	0,63%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	5.124.361,76	511,42	0,95%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	2.387.528,13	5,87	0,44%
Debênture simples	GUAR11	GUARARAPES CONF	3.822.566,63	381,83	0,71%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.319.316,45	5,00	0,43%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.195.384,82	3,04	0,41%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	1.973.341,17	38,92	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	1.915.794,32	38,05	0,36%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	3.074.951,85	3.162,67	0,57%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	1.738.860,06	1.754,31	0,32%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	3.748.128,27	3.881,31	0,70%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	4.817.349,50	4.861,96	0,90%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial f	LOCALIZA	1.572.950,08	1,52	0,29%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	2.373.938,96	237,88	0,44%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	1.403.056,62	1.453,15	0,26%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	1.588.254,60	157,21	0,30%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		1.350.295,30	125,90	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	1.251.164,76	4,78	0,23%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	1.345.051,66	134,60	0,25%
Debênture simples	AMPL19	AMPLA	2.131.709,33	2.109,61	0,40%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	1.072.076,96	1.225,71	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	1.055.636,97	3,91	0,20%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	1.349.006,86	1.348,13	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	991.821,61	3,70	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	979.203,15	19,13	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	969.580,32	19,13	0,18%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		936.699,44	87,41	0,17%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	906.718,71	912,60	0,17%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	886.463,27	5,44	0,17%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	850.179,66	881,72	0,16%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	1.062.406,25	1.075.566,23	0,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	788.997,56	3,04	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	776.228,06	746,69	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	775.933,62	746,47	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	656.618,90	3,91	0,12%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	630.441,08	635,58	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	614.251,23	2,17	0,11%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	598.185,65	2,61	0,11%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	1.317.542,20	1.348,13	0,25%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	548.336,85	2,39	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	547.182,42	3,26	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	520.121,41	2,39	0,10%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	1.437.042,60	142,64	0,27%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	495.244,60	47,84	0,09%

Debênture simples	SBSPB3	SABESP	470.381,50	488,15	0,09%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	726.726,85	724,29	0,14%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	446.278,88	42,18	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	437.815,83	1,96	0,08%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	2.254.182,88	2.321,83	0,42%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	1.422.807,64	151,77	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	429.975,86	1,52	0,08%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	429.975,86	1,52	0,08%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	722.082,45	737,34	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	398.790,43	1,74	0,07%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	387.463,74	389,65	0,07%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	381.444,98	381,17	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	355.290,95	2,17	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	351.801,32	1,96	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	341.921,32	6,74	0,06%
Debênture simples	MOV115	MOVIDA PARTI	341.889,58	340,95	0,06%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	687.123,99	908,47	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	335.023,74	1,52	0,06%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		327.047,03	282,67	0,06%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	311.842,26	31,75	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	308.224,56	306,81	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	303.101,15	0,65	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	291.287,00	1,74	0,05%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	281.206,25	280,06	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	261.818,52	1,09	0,05%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	496.662,92	49,79	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	257.774,43	0,43	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	254.923,49	247,45	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	254.921,49	247,45	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	237.081,67	0,87	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	227.882,67	1,09	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	201.607,03	0,65	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	195.488,33	0,43	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	184.275,37	0,65	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	184.275,37	0,65	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	177.245,74	1,09	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	175.939,50	0,65	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	170.690,31	17,18	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	158.054,45	0,43	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	122.850,25	0,43	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	97.744,16	0,22	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	58.646,50	0,22	0,01%
Operações Compromissadas	LFT_14072017_01092023		25.521,38	2,39	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		664,67	3,48	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22		-58,65	-1,96	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F22		-23.694,66	-561,87	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		24.774.079,95	5.590,77	4,61%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		21.833.076,81	5.780,47	4,07%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		18.057.902,35	4.767,80	3,36%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		14.687.734,30	3.780,56	2,73%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		13.961.984,81	3.288,32	2,60%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		12.693.506,70	3.021,06	2,36%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		10.108.984,83	2.851,64	1,88%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		10.051.345,45	2.578,29	1,87%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		8.440.453,33	1.963,31	1,57%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		8.429.596,40	1.891,74	1,57%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		8.009.463,06	1.924,74	1,49%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		6.677.121,64	1.700,87	1,24%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		3.919.547,32	958,26	0,73%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		565.449,09	690,42	0,11%

Total

537.094.291,56

100,00%