

<u>Segmentos</u>	<u>Tipo de Ativo</u>	<u>Quantidade</u>	<u>Valores em Reais</u>	<u>Participação</u>
<u>Disponível</u>			468.920,07	0,005%
Total do Disponível			468.920,07	0,005%
<u>Operações com Participantes</u>				
Empréstimos	Empréstimos		146.291.681,96	1,71%
Financiamentos	Financiamentos		1.351.306,41	0,02%
Total Operações com Participantes			147.642.988,37	1,72%
<u>Fundos</u>				
Marbella II	Cotas de Fundos	1.491.066.998,90676000	7.802.637.018,75	91,08%
Hermes	Cotas de Fundos	17.648.938,56530310	467.522.922,63	5,46%
Quiron	Cotas de Fundos	31.268.245,80313230	83.366.813,19	0,97%
Vinci FI RF Imobiliário CP II	Cotas de Fundos	76.402,66280000	8.305.812,09	0,10%
Sub-total			8.361.832.566,66	97,61%
<u>F.I.D.C.</u>				
Agro +	Cotas de Fundos	5,99999999	107.200,06	0,00%
Sub-total			107.200,06	0,00%
Total Renda Fixa			8.361.939.766,72	97,61%
<u>Imobiliário</u>				
Campinas	Imóveis		19.218.756,04	0,22%
FII RB Capital	Cotas de Fundos	28.096,00000000	5.618.919,04	0,07%
FII Rio Bravo Renda Corporativa	Cotas de Fundos	26.209,00000000	4.355.935,80	0,05%
Total Imobiliário			29.193.610,88	0,34%
<u>Estruturados</u>				
<u>FIP's</u>				
Brasil Mezanino	Cotas de Fundos	12.135.958,71971030	836.835,03	0,01%
Brasil/Energia	Cotas de Fundos	390,20986239	179.971,17	0,00%
Caixa Ambiental	Cotas de Fundos	-	0,00	0,00%
GG Governança e Gestão II	Cotas de Fundos	5.330,42011996	1.482.224,14	0,02%
Terra Viva	Cotas de Fundos	98,25611112	1.747,61	0,00%
InfraBrasil Senior	Cotas de Fundos	2.034,16564619	4.625.361,56	0,05%
F. Brasil de Intern. de Empresas	Cotas de Fundos	14.377,99181000	16.538.648,78	0,19%
Rio Bravo Energia I	Cotas de Fundos	150,00000990	3.166.229,33	0,04%
Brasil Petroleo	Cotas de Fundos	16.012,83537000	1.862.439,55	0,02%
Sub-total			28.693.457,17	0,33%
<u>Exigível Operacional</u>				
Investimentos			442.127,20	0,01%
Total Exigível Operacional			442.127,20	0,01%
<u>Exigível Contingencial</u>				
Investimentos			588.486,50	0,01%
Total Exigível Contingencial			588.486,50	0,01%
Total Plano II			8.566.908.129,51	100,00%

MARBELLA II - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	QT de Cotas 1491066999
Renda Fixa	

Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Títulos Públicos	NTNC_01012001_01012031		2.776.196.617,89	317.082,00	35,58
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		1.441.842.676,76	299.635,00	18,48
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		903.656.754,51	195.504,00	11,58
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		845.690.322,96	210.466,00	10,84
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		638.835.539,50	141.341,00	8,19
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		381.577.838,23	86.871,00	4,89
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		364.117.933,01	78.498,00	4,67
Títulos Públicos	NTNC_01042001_01042021		264.357.742,13	50.790,00	3,39
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		65.920.530,80	15.370,00	0,85
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		65.607.569,48	15.769,00	0,84
Títulos Públicos	NTNB_15032002_15032023		20.937.145,08	5.414,00	0,27
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		ITAU UNIBANCO S	17.390.141,08	23,00	0,22
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		11.780.986,40	13.926,00	0,15
Depósitos a prazo e outros título Letra Financeira		SAFRA S/A	6.758.975,30	6,00	0,09
Debênture simples	CMDT23	CEMIG DISTRIB.	2.707.566,06	5.000,00	0,04
Valores a receber	Valores a Receber		6.125,55		0,00
Disponibilidades	Disponibilidade		9.807,60		0,00
Valores a pagar	Valores a Pagar		-4.757.241,58		-0,06
Total			7.802.637.030,76		100,00

HERMES FIC DE FI MULTIMERCADO			QT de Cotas	17648939	
Renda Fixa					
Descrição Ativo	Ativo	Nome Emissor	Valor	Quantidade	(%)
Disponibilidades	Disponibilidade		4.961,56	0,00	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		577,94	0,00	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-80.183,88	0,00	-0,02%
Títulos Públicos	LFT_14072017_01092023		146.513.983,37	13.655,79	31,34%
Títulos Públicos	NTNB_13102011_15082022		52.251.976,21	13.665,43	11,18%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		21.735.305,00	25.692,74	4,65%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	10.903.104,87	51,44	2,33%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	5.798.244,86	113,01	1,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SANT BANESPA	5.760.427,46	113,01	1,23%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO CNH	5.672.862,15	5,56	1,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	DPGE	BANCO C6 S.A	5.597.970,58	5,56	1,20%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	4.075.057,61	15,69	0,87%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	3.351.600,04	65,94	0,72%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	3.118.747,75	14,50	0,67%
Debênture simples	VIVT15	TELEFÔNICA BRAS	4.693.305,24	467,15	1,00%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	2.188.379,42	5,36	0,47%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.127.956,50	4,57	0,46%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	2.016.540,69	2,78	0,43%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	1.804.512,95	35,55	0,39%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	1.746.835,83	34,76	0,37%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	1.681.034,52	33,57	0,36%
Debênture simples	PARD12	INSTITUTO HERME	2.800.710,16	2.888,90	0,60%
Debênture simples	ELET12	ELETROBRAS	1.819.604,49	1.830,27	0,39%
Debênture simples	ELET32	ELETROBRAS	3.436.132,95	3.545,33	0,73%
Debênture simples	PETR35	PETROBRAS S/A	4.423.372,97	4.441,10	0,95%
Títulos de Crédito Privado	Nota Promissória/ Commercial F	LOCALIZA	1.442.270,17	1,39	0,31%
Debênture simples	LAMEA1	LOJAS AMERICANA	2.173.182,72	217,29	0,46%
Debênture simples	GGBRA5	GERDAU S.A.	1.292.318,98	1.327,36	0,28%
Debênture simples	NATU27	NATURA COSMETIC	1.455.630,02	143,60	0,31%
Títulos Públicos	LFT_08012016_01032022		1.235.827,11	115,00	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	1.145.290,28	4,37	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	1.127.070,09	22,44	0,24%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	1.112.612,62	22,25	0,24%
Debênture simples	GUAR24	GUARARAPES CONF	1.060.526,21	1.056,65	0,23%
Debênture simples	SSED11	SABER SERVIÇOS	1.232.398,69	122,94	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	984.563,20	3,58	0,21%
Debênture simples	CMGD17	CEMIG DISTRIB.	956.784,45	1.119,61	0,20%
Debênture simples	CBRDA6	CIA BRASILEIRA	1.235.510,95	1.231,43	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	909.184,18	3,38	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO CITIBANK	896.994,13	17,48	0,19%
Debênture simples	NCFP14	NCF Participaçõ	899.348,06	898,75	0,19%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO ALFA DE INV	889.626,20	17,48	0,19%
Títulos Públicos	LFT_08072016_01092022		857.475,26	79,84	0,18%
Debênture simples	LIGH	LIGHT SERVICOS	831.583,85	833,60	0,18%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	811.378,95	4,97	0,17%
Debênture simples	CPGT16	COPEL GERAÇÃO	780.822,65	805,40	0,17%
Debênture simples	CPGT14	COPEL GERAÇÃO	973.446,29	982.462,45	0,21%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ITAU S/A	722.162,11	2,78	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	710.470,24	682,05	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	CDB/ RDB	BANCO GMAC S/A	710.202,51	681,86	0,15%
Debênture simples	BSA313	B3 SA	699.030,24	68,52	0,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	601.852,90	3,58	0,13%
Debênture simples	CELP	EQUATORIAL PARA	577.268,66	580,56	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	570.130,29	1,99	0,12%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	547.579,43	2,38	0,12%
Debênture simples	IOCH18	IOCHPE MAXION	1.208.457,72	1.231,43	0,26%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	501.947,81	2,18	0,11%

Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	501.544,09	2,98	0,11%
Debênture simples	UNDA20	UNIDAS S/A	1.316.614,16	130,29	0,28%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	476.071,55	2,18	0,10%
Debênture simples	LAMEA4	LOJAS AMERICANA	453.905,14	43,70	0,10%
Debênture simples	SBSBP3	SABESP	431.259,52	445,90	0,09%
Debênture simples	TIET27	ENERGIA PAULIST	666.063,48	661,60	0,14%
Debênture simples	HAPV11	Hapvida Part	2.075.358,53	2.120,84	0,44%
Debênture simples	LAMEA5	LOJAS AMERICANA	399.215,38	38,53	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	400.843,99	1,79	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	399.091,20	1,39	0,09%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	399.091,20	1,39	0,09%
Debênture simples	CEPE18	CELPE	1.308.471,93	138,64	0,28%
Debênture simples	LORTA2	LOCALIZA RENT A	663.538,50	673,51	0,14%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	PARANA BANCO SA	365.052,95	1,59	0,08%
Debênture simples	ELPLA3	ELETROPAULO MET	355.445,47	355,92	0,08%
Debênture simples	BCBF15	BCBF PART SA	349.796,92	348,18	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	335.718,33	1,59	0,07%
Debênture simples	ENGIA3	ENERGISA S/A.	326.287,94	319,58	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	SAFRA S/A	325.399,96	1,99	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	322.341,70	1,79	0,07%
Debênture simples	LCAMA9	CIA LOCA DAS AM	316.558,84	316,40	0,07%
Títulos Públicos	NTNF_10012014_01012025		311.194,94	258,20	0,07%
Debênture simples	MOVI15	MOVIDA PARTI	313.483,36	311,43	0,07%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BCO VOTORANTIM	312.569,41	6,16	0,07%
Debênture simples	CLOR11	Celeo Redes Tra	629.688,36	829,83	0,13%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	306.958,17	1,39	0,07%
Debênture simples	CEEBB0	COELBA	286.310,72	29,00	0,06%
Debênture simples	CBRDB6	CIA BRASILEIRA	282.088,06	280,25	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	278.087,22	0,60	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO ABC S/A	266.699,01	1,59	0,06%
Debênture simples	SEDU12	Somos Educação	257.666,56	255,82	0,06%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	239.776,79	0,99	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	236.112,04	0,40	0,05%
Debênture simples	LORTA1	LOCALIZA RENT A	450.451,04	45,48	0,10%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	220.847,20	0,79	0,05%
Debênture simples	RDCO20	RODOVIAS DAS CO	213.479,34	213,32	0,05%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	Banco Daycoval	209.823,96	0,99	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	187.224,14	0,60	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	182.326,52	0,40	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	171.039,09	0,60	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	171.039,09	0,60	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	164.093,87	0,60	0,04%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BC FIDIS INVEST	162.232,85	0,99	0,03%
Debênture simples	LORTA3	LOCALIZA	154.801,71	15,69	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	147.231,47	0,40	0,03%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	BANCO BRADESCO	114.026,06	0,40	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	91.163,26	0,20	0,02%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	Letra Financeira	ITAU UNIBANCO H	54.697,96	0,20	0,01%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1F23		19.572,24	247,88	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	FUTDI1J22		50,87	1,79	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	FUTDI1F25		-326,21	-3,18	0,00%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082050		21.802.798,06	4.530,93	4,66%
Títulos Públicos	NTNB_15012014_15052023		18.782.284,02	4.862,35	4,02%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		12.178.308,32	2.634,75	2,60%
Títulos Públicos	NTNB_15102003_15082024		12.116.391,29	3.015,39	2,59%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		10.999.835,12	2.433,69	2,35%
Títulos Públicos	NTNB_08012020_15052025		9.058.019,41	2.241,59	1,94%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15052021		8.329.995,43	2.349,91	1,78%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		7.607.196,98	1.562,93	1,63%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		7.271.227,90	1.655,39	1,56%

Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040	7.216.640,09	1.555,79	1,54%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026	5.624.661,22	1.351,91	1,20%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028	3.317.516,76	773,51	0,71%
Total		467.522.922,63		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		24.074.186,91	5.002,95	28,88%
Títulos Públicos	NTNB_15082004_15052045		13.591.416,01	2.940,47	16,30%
Títulos Públicos	NTNB_07032006_15052035		12.197.910,12	2.698,76	14,63%
Títulos Públicos	NTNB_14012015_15052055		8.165.350,24	1.677,61	9,79%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082040		7.945.461,53	1.712,91	9,53%
Títulos Públicos	NTNB_10022010_15082030		7.483.016,54	1.703,60	8,98%
Títulos Públicos	NTNB_06012016_15082026		6.246.916,57	1.501,47	7,49%
Títulos Públicos	NTNB_10012018_15082028		3.647.475,01	850,44	4,38%
Operações Compromissadas	LTN_03012020_01012024		22.646,93	26,77	0,03%
Disponibilidades	Disponibilidade		3.693,70	-	0,00%
Valores a receber	Valores a Receber		209,78	-	0,00%
Valores a pagar	Valores a Pagar		-11.470,15	-	-0,01%
Total			83.366.813,19		100,00%