

MSD - OBS PREV

Posição Patrimonial

30/04/2018

Código do Ativo	Descrição	Ratings			Quantidade	Pu	Valor Total	% do Patrimônio
		S&P	Moody's	Fitch				
RENDA VARIÁVEL								
Fundos de Investimento								
FI								
BRWES6CTF009	FIABDRI-WA FIA BDR NIVEL I				2.973,19	2.502,9056	7.441.615,21	4,60%
						Total FI:	7.441.615,21	4,60%
						Total Renda Variável:	7.441.615,21	4,60%
RENDA FIXA								
Caixa								
	Caixa Disponível						1.000,00	0,00%
						Total Caixa:	1.000,00	0,00%
Fundos de Investimento								
FI								
BRFVD1CTF007	111 FI RF CP				207,47	1.115,4370	231.414,58	0,14%
BRFVD2CTF005	112 FI RF CP				436,02	1.112,4098	485.029,02	0,30%
BRFVD3CTF003	113 FI RF CP				329,88	1.124,4322	370.930,04	0,23%
BRIFI1CTF006	WESTERN ASSET INFLATION II RENDA FIXA FI				255,74	4.566,9574	1.167.946,38	0,72%
BRIFL6CTF003	WA INFLAÇÃO IMPLÍCITA FI RF				789.435,73	2,0802	1.642.182,54	1,02%
BRLEG2CTF005	LEGG MASON LONG & SHORT MULTIM. FI LP				1.822,54	4.052,5656	7.385.949,19	4,57%
BRUS1CTF008	WA US INDEX 500 FI MULTIMERCADO				2.618.456,53	2,6884	7.039.360,34	4,36%
BRUUC1CTF000	BRUUC1				347,55	650,0698	225.931,30	0,14%
BRWAP1CTF007	WESTERN ASSET PREV FIX TARGET RF FI				2.666,77	3.977,7270	10.607.679,55	6,56%
BRWAP3CTF003	WESTERN ASSET PREV CREDIT FI RF CREDI				1.712,70	33.115,6249	56.717.044,67	35,09%
BRWAP4CTF001	WA PREV STRUCTURED CREDIT FIC FIM CP				161,42	36.137,3116	5.833.310,14	3,61%
BRWAS4CTF008	WESTERN ASSET SOVEREIGN IV				11.400,22	2.641,9553	30.118.880,41	18,64%
BRWAS7CTF001					5.000,00	1.008,1468	5.040.733,93	3,12%
BRWST2CTF001	WESTERN ASSET PREV INFLAT LIMITED RF FI				426,24	3.667,8042	1.563.379,55	0,97%
BRWST3CTF009	WESTERN ASSET PREV INFLATION PLUS RF FI				529,59	3.961,8298	2.098.162,90	1,30%
BRWST4CTF007	WESTERN ASSET PREV INFLATION TOTAL RF FI				4.450,88	3.707,5602	16.501.908,72	10,21%
BRWTR2CTF002	WA MACRO OPPORTUNITIES FIM NO EXTERIOR				4.932,61	1.447,3297	7.139.119,46	4,42%
						Total FI:	154.168.962,72	95,39%
						Total Renda Fixa:	154.169.962,72	95,40%

MSD - OBS PREV

Posição Patrimonial

30/04/2018

Código do Ativo	Descrição	Ratings			Quantidade	Pu	Valor Total	% do Patrimônio
		S&P	Moody's	Fitch				
						Total:	<u>161.611.577,93</u>	<u>100,00%</u>

As informações constantes do presente relatório foram geradas com base em precificação gerencial de ativos pela Western Asset e não com base na precificação oficial dos títulos e valores mobiliários calculada pelo prestador de serviços de custódia e controladoria. Por esta razão, os dados deste relatório são meramente gerenciais. A Western Asset não se responsabiliza pelo uso indevido destas informações.