

MSD Prev - Soc Previdência Privada

Posição Patrimonial

31/12/2018

Código do Ativo	Descrição	Ratings			Quantidade	Pu	Valor Total	% do Patrimônio
		S&P	Moody's	Fitch				
RENTA VARIÁVEL								
Fundos de Investimento								
FI								
BRWES6CTF009	FIABDRI-WA FIA BDR NIVEL I				10.758,10	2.650,3398	28.512.607,45	4,56%
						Total FI:	28.512.607,45	4,56%
						Total Renda Variável:	28.512.607,45	4,56%
RENTA FIXA								
Caixa								
Caixa Disponível							1.000,00	0,00%
						Total Caixa:	1.000,00	0,00%
Fundos de Investimento								
FI								
BRFI95CTF002	095 FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO				1.030,41	858,0026	884.093,37	0,14%
BRFVD1CTF007	111 FI RF CP				779,42	1.167,2000	909.744,01	0,15%
BRFVD2CTF005	112 FI RF CP				1.638,07	1.165,7369	1.909.553,45	0,31%
BRFVD3CTF003	113 FI RF CP				1.231,27	1.183,1895	1.456.823,99	0,23%
BRFVS2CTF008	107 FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO				916,36	579,8998	531.396,56	0,09%
BRIFIICTF006	WESTERN ASSET INFLATION II RENDA FIXA FI				2.338,43	4.651,4714	10.877.157,97	1,74%
BRIFL6CTF003	WA INFLAÇÃO IMPLÍCITA FI RF				4.750.295,49	2,1714	10.314.670,01	1,65%
BRLEG2CTF005	LEGG MASON LONG & SHORT MULTIM. FI LP				6.741,72	4.206,7617	28.360.821,57	4,54%
BRUS1CTF008	WA US INDEX 500 FI MULTIMERCADO				10.844.369,00	2,6315	28.536.876,77	4,57%
BRUUC1CTF000	BRUUC1				1.305,70	767,0042	1.001.480,40	0,16%
BRWAP1CTF007	WESTERN ASSET PREV FIX TARGET RF FI				10.280,18	4.268,8828	43.884.863,52	7,02%
BRWAP3CTF003	WESTERN ASSET PREV CREDIT FI RF CREDI				6.408,39	34.731,9027	222.575.512,09	35,61%
BRWAP4CTF001	WA PREV STRUCTURED CREDIT FIC FIM CP				953,43	38.243,6327	36.462.737,62	5,83%
BRWAS4CTF008	WESTERN ASSET SOVEREIGN IV				37.275,59	2.752,1638	102.588.525,98	16,41%
BRWST2CTF001	WESTERN ASSET PREV INFLAT LIMITED RF FI				1.805,77	3.879,1249	7.004.810,09	1,12%
BRWST3CTF009	WESTERN ASSET PREV INFLATION PLUS RF FI				1.727,59	4.338,4653	7.495.105,34	1,20%
BRWST4CTF007	WESTERN ASSET PREV INFLATION TOTAL RF FI				15.853,93	4.006,8583	63.524.460,86	10,16%
BRWTR2CTF002	WA MACRO OPPORTUNITIES FIM NO EXTERIOR				19.782,99	1.429,1213	28.272.293,65	4,52%
						Total FI:	596.590.927,25	95,44%
						Total Renda Fixa:	596.591.927,25	95,44%

MSD Prev - Soc Previdência Privada

Posição Patrimonial

31/12/2018

Código do Ativo	Descrição	Ratings			Quantidade	Pu	Valor Total	% do Patrimônio
		S&P	Moody's	Fitch				
						Total:	<u>625.104.534,70</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.