



i9ADVISORY

PERFORMANCE | MSD PREV

MSD PREV
28/02/2020
RENTABILIDADE E CARTEIRA - WESTERN

	MÊS	ANO	12 MESES
MSD PREV CARTEIRA WESTERN	0,38%	1,23%	8,78%
CDI	0,29%	0,67%	5,60%
% CDI	128,42%	182,98%	156,77%

FUNDOS DE RENDA FIXA

	MÊS	ANO	12 MESES
107 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	3,59%	3,92%	40,27%
111 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,28%	0,63%	5,32%
112 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,29%	0,66%	5,60%
113 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,27%	0,67%	6,25%
130 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,33%	0,73%	0,93%
131 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,91%	1,44%	-7,08%
WESTERN ASSET INFLATION II FI RENDA FIXA	0,65%	0,25%	24,01%
WESTERN ASSET PREV CREDIT FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,29%	0,72%	5,40%
WESTERN ASSET PREV FIX TARGET FI RENDA FIXA	1,04%	2,23%	13,45%
WESTERN ASSET PREV INFLAÇÃO IMPLÍCITA FI RENDA FIXA	0,28%	0,62%	5,48%
WESTERN ASSET PREV STRUCTURED CREDIT FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,43%	0,96%	7,55%
WESTERN ASSET SOVEREIGN IV FI RENDA FIXA REFERENCIADO SELIC	0,28%	0,66%	5,59%
CDI	0,29%	0,67%	5,60%

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL NO EXTERIOR

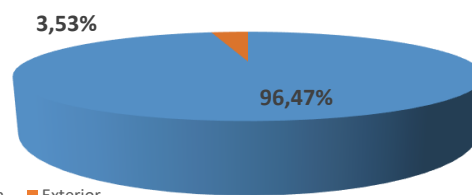
	MÊS	ANO	12 MESES
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,97%	5,27%	35,05%
WESTERN ASSET GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	-4,10%	1,75%	
MSCI World	-3,69%	1,33%	23,26%

COMPOSIÇÃO MSD PREV CARTEIRA WESTERN

107 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,17%	WESTERN ASSET INFLATION II FI RENDA F	6,57%
111 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,20%	WESTERN ASSET PREV FIX TARGET FI REN	30,63%
112 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,42%	WESTERN ASSET PREV INFLAÇÃO IMPLÍCITA	1,78%
113 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,18%	WESTERN ASSET PREV STRUCTURED CREDI	8,04%
130 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,28%	WESTERN ASSET SOVEREIGN IV FI RENDA	2,36%
131 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,08%	WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,35%
WESTERN ASSET PREV CREDIT FI RENDA F	45,76%	WESTERN ASSET GLOBAL EQUITIES INVES	3,18%

TOTAL POR SEGMENTO

Renda Fixa	96,47%
Exterior	3,53%


PATRIMÔNIO

Western	R\$	486.258.272,64
---------	-----	----------------

■ Renda Fixa ■ Exterior

MSD PREV

28/02/2020

RENTABILIDADE E CARTEIRA - GLADIADOR

	MÊS	ANO	12 MESES
GLADIADOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-3,05%	-2,33%	
CDI	0,29%	0,67%	5,60%
IBOVESPA	-8,43%	-9,92%	7,05%
% CDI	-1038,05%	-346,60%	

* O fundo iniciou as atividades em agosto/2019.

FUNDOS DE RENDA FIXA	MÊS	ANO	12 MESES
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,26%	0,60%	9,58%
ITAÚ CUSTÓDIA CAIXA FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,26%	0,61%	5,18%
CDI	0,29%	0,67%	5,60%

FUNDOS MULTIMERCADOS	MÊS	ANO	12 MESES
ABSOLUTE VERTEX II FIC MULTIMERCADO	-1,33%	-0,36%	6,46%
CANVAS ENDURO II FIC MULTIMERCADO	-2,70%	-4,25%	3,72%
CANVAS VECTOR FIC MULTIMERCADO	-2,07%	1,23%	18,66%
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO PLUS FIC MULTIMERCADO	-0,62%	-0,72%	8,47%
MOAT CAPITAL EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	0,31%	-0,28%	10,41%
OCCAM EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	-0,16%	0,60%	8,32%
VINLAND MACRO FIC MULTIMERCADO	0,00%	0,48%	9,07%
JGP SELECT FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,47%	0,32%	6,73%
CDI	0,29%	0,67%	5,60%

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	MÊS	ANO	12 MESES
LEBLON AÇÕES II FIC AÇÕES	-8,35%	-8,11%	18,83%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	-8,75%	-9,36%	18,38%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	-5,42%	-3,77%	28,53%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-5,44%	-3,82%	30,41%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES	-7,00%	-6,44%	
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-8,62%	-6,30%	39,36%
IBOVESPA	-8,43%	-9,92%	7,05%

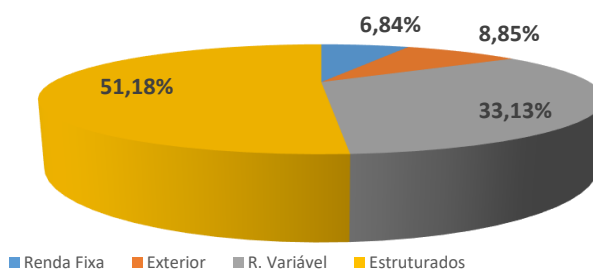
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL NO EXTERIOR	MÊS	ANO	12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,24%	1,37%	30,01%
PIMCO INCOME INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-0,56%	-0,05%	8,32%
MSCI World	-3,69%	1,33%	23,26%

MSD PREV
28/02/2020
RENTABILIDADE E CARTEIRA
COMPOSIÇÃO MSD PREV CARTEIRA GLADIADOR

ABSOLUTE VERTEX II FIC MULTIMERCADC	11,81%	LEBLON AÇÕES II FIC AÇÕES	7,81%
CANVAS ENDURO II FIC MULTIMERCADO	6,86%	MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	4,78%
CANVAS VECTOR FIC MULTIMERCADO	7,92%	VINCI MOSAICO FI AÇÕES	5,33%
ITAÚ GLOBAL DINÂMICO PLUS FIC MULTII	8,29%	CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	7,96%
MOAT CAPITAL EQUITY HEDGE FIC MULTI	3,35%	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES	3,66%
OCCAM EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCA	6,25%	EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,59%
VINLAND MACRO FIC MULTIMERCADO	3,38%	SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,45%
JGP SELECT FIC MULTIMERCADO CRÉDITC	3,32%	PIMCO INCOME INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIM	4,40%
ITAÚ CUSTÓDIA CAIXA FI RENDA FIXA CUI	0,38%	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FI	6,46%

TOTAL POR SEGMENTO

Renda Fixa	6,84%
Exterior	8,85%
R. Variável	33,13%
Estruturados	51,18%


PATRIMÔNIO

Gladiador	R\$	177.602.942,35
-----------	-----	----------------

MSD PREV

28/02/2020

ANÁLISE DE CUSTOS E RECEITAS

GLADIADOR FICFI MULTIMERCADO		MÊS
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	-R\$	29.545,47
TAXA DE CUSTÓDIA	-R\$	3.776,55
TAXA CETIP	-R\$	4.052,73
TAXA DE FISCALIZAÇÃO CVM	R\$	-
TAXA ANBID	-R\$	775,00
TAXA CARTÓRIO	R\$	-
TAXA SELIC	R\$	-
TOTAL DESPESAS (CAIXA)	-R\$	38.149,75
TOTAL REBATES RECEBIDOS (CAIXA)	R\$	32.396,95
TOTAL REBATES A RECEBER (COMPETÊNCIA)	R\$	8.745,69
TOTAL RECEITAS	R\$	41.142,64
CUSTO TOTAL LÍQUIDO	R\$	2.992,89

ANÁLISE DE CUSTOS E RECEITAS

MSD PREV CARTEIRA WESTERN		MÊS
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	-R\$	53.755,06
TAXA CETIP	-R\$	3.434,78
TAXA DE CUSTÓDIA	-R\$	3.800,00
TOTAL CUSTOS	-R\$	60.989,84
TOTAL RECEITAS	R\$	-
CUSTO TOTAL LÍQUIDO	-R\$	60.989,84

MSD PREV
28/02/2020
RENTABILIDADE E CARTEIRA - CONSOLIDADA

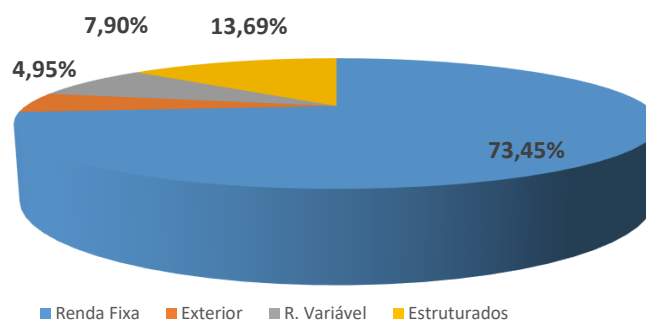
	MÊS	ANO	12 MESES
MSD PREV	-0,58%	0,17%	8,63%
CDI	0,29%	0,67%	5,60%
% CDI	-196,51%	25,37%	154,16%
RENDA FIXA	0,51%	1,13%	7,34%
RENDA VARIÁVEL	-5,80%	-4,88%	14,15%
ESTRUTURADO	-1,08%	-0,57%	6,31%
EXTERIOR	-2,43%	2,54%	20,09%
IPCA	0,25%	0,46%	4,03%
IBOVESPA	-8,43%	-9,92%	7,05%

COMPOSIÇÃO MSD PREV

107 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,12%	ABSOLUTE VERTEX II FIC MULTIMERCADO	3,16%
111 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,15%	CANVAS ENDURO II FIC MULTIMERCADO	1,84%
112 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,31%	CANVAS VECTOR FIC MULTIMERCADO	2,12%
113 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,13%	ITAÚ GLOBAL DINÂMICO PLUS FIC MULTIM	2,22%
130 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,21%	MOAT CAPITAL EQUITY HEDGE FIC MULTIM	0,90%
131 FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,06%	OCCAM EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	1,67%
WESTERN ASSET PREV CREDIT FI RENDA FI	33,52%	VINLAND MACRO FIC MULTIMERCADO	0,90%
WESTERN ASSET INFLATION II FI RENDA FI	4,81%	JGP SELECT FIC MULTIMERCADO CRÉDITO	0,89%
WESTERN ASSET PREV FIX TARGET FI REND	22,43%	LEBLON AÇÕES II FIC AÇÕES	2,09%
WESTERN ASSET PREV INFLAÇÃO IMPLÍCIT	1,30%	MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	1,28%
WESTERN ASSET PREV STRUCTURED CRED	5,89%	VINCI MOSAICO FI AÇÕES	1,43%
WESTERN ASSET SOVEREIGN IV FI RENDA I	1,73%	CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2,13%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,26%	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇ	0,98%
WESTERN ASSET GLOBAL EQUITIES INVEST	2,33%	EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC A	0,96%
ITAÚ CUSTÓDIA CAIXA FI RENDA FIXA CUR	0,10%	SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕE	1,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMIC	1,73%	PIMCO INCOME INVESTIMENTO NO EXTER	1,18%

TOTAL POR SEGMENTO

Renda Fixa	73,45%
Exterior	4,95%
R. Variável	7,90%
Estruturados	13,69%


PATRIMÔNIO TOTAL

MSD PREV	R\$	663.861.214,99
----------	-----	----------------



Av. Queiroz Filho, 1560, Torre Gaivota, Conjunto 111
Vila Hamburguesa | São Paulo | SP | CEP: 05319-000

Tel: (11) 2359-9440 | 2359-9488
www.i9advisory.com
contato@i9advisory.com