

MSD Prev - Soc Previdência Privada

Posição Patrimonial

31/12/2015

Código do Ativo	Descrição	Ratings			Quantidade	Pu	Valor Total	% do Patrimônio
		S&P	Moody's	Fitch				
RENTA VARIÁVEL								
Fundos de Investimento								
FI								
BRLEG1CTF007	LEGIBRX-LEGG MASON PREV IBRX ATIVO AÇÕES FI				13.771,46	1.004,9797	13.840.032,97	4,69%
BRWES6CTF009	FIABDRI-WA FIA BDR NIVEL I				11.667,04	2.203,9306	25.713.337,22	8,71%
						Total FI:	39.553.370,19	13,40%
						Total Renda Variável:	39.553.370,19	13,40%
RENTA FIXA								
Caixa								
Caixa Disponível							1.000,37	0,00%
						Total Caixa:	1.000,37	0,00%
Fundos de Investimento								
FI								
BRFI95CTF002	095 FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO				502,65	1.001,7161	503.515,60	0,17%
BRIFIICTF006	WESTERN ASSET INFLATION II RENDA FIXA FI				45,99	2.991,4037	137.586,92	0,05%
BRIFL6CTF003	WA INFLAÇÃO IMPLÍCITA FI RF				587.607,51	1,6257	955.280,52	0,32%
BRUS11CTF008	WA US INDEX 500 FI MULTIMERCADO				12.476.519,97	1,6969	21.171.728,63	7,17%
BRWAP1CTF007	WESTERN ASSET PREV FIX TARGET RF FI				11.218,52	2.452,1710	27.509.725,21	9,32%
BRWAP3CTF003	WESTERN ASSET PREV CREDIT FI RF CREDI				2.798,56	25.396,3812	71.073.227,97	24,07%
BRWAP4CTF001	WA PREV STRUCTURED CREDIT FIC FIM CP				511,64	26.716,9993	13.669.424,09	4,63%
BRWAS4CTF008	WESTERN ASSET SOVEREIGN IV				19.086,99	2.064,6637	39.408.207,03	13,35%
BRWST2CTF001	WESTERN ASSET PREV INFLAT LIMITED RF FI				1.067,17	2.704,5199	2.886.188,21	0,98%
BRWST3CTF009	WESTERN ASSET PREV INFLATION PLUS RF FI				1.923,89	2.553,5868	4.912.814,43	1,66%
BRWST4CTF007	WESTERN ASSET PREV INFLATION TOTAL RF FI				24.292,35	2.568,7296	62.400.473,08	21,14%
BRWST6CTF002	WESTERN ASSET PREV MULTITRADING FI MULT				4.929,56	2.241,9945	11.052.041,42	3,74%
						Total FI:	255.680.213,11	86,60%
						Total Renda Fixa:	255.681.213,48	86,60%
						Total:	295.234.583,67	100,00%

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.