

MSD Prev - Soc Previdência Privada

Posição Patrimonial

30/11/2016

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				5.460,54	2.010,6304	10.979.120,68	3,22%
						Total FI:	10.979.120,68	3,22%
						Total Renda Variável:	10.979.120,68	3,22%
RENTA FIXA								
Caixa								
	Caixa Disponível						1.000,07	0,00%
						Total Caixa:	1.000,07	0,00%
Fundos de Investimento								
FI								
BRFI95CTF002	095 FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO				1.030,41	1.053,0516	1.085.073,56	0,32%
BRFIV8CTF007	101 FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO				862,48	934,4406	805.939,19	0,24%
BRFVS2CTF008	107 FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO				916,36	886,1144	811.999,13	0,24%
BRIFIICTF006	WESTERN ASSET INFLATION II RENDA FIXA FI				3.888,59	3.731,5864	14.510.621,05	4,26%
BRIFL6CTF003	WA INFLAÇÃO IMPLÍCITA FI RF				2.923.456,79	1,8454	5.394.943,94	1,58%
BRLEG2CTF005	LEGG MASON LONG & SHORT MULTIM. FI LP				3.623,84	3.524,1452	12.770.953,28	3,75%
BRUS11CTF008	WA US INDEX 500 FI MULTIMERCADO				6.961.916,94	2,0196	14.060.629,28	4,13%
BRWAP1CTF007	WESTERN ASSET PREV FIX TARGET RF FI				2.117,36	2.981,9179	6.313.804,43	1,85%
BRWAP3CTF003	WESTERN ASSET PREV CREDIT FI RF CREDI				4.037,21	28.866,4115	116.539.834,28	34,21%
BRWAP4CTF001	WA PREV STRUCTURED CREDIT FIC FIM CP				511,64	30.775,2388	15.745.772,40	4,62%
BRWAS4CTF008	WESTERN ASSET SOVEREIGN IV				36.793,34	2.325,1625	85.550.491,63	25,11%
BRWST2CTF001	WESTERN ASSET PREV INFLAT LIMITED RF FI				1.000,38	3.082,9308	3.084.107,51	0,91%
BRWST3CTF009	WESTERN ASSET PREV INFLATION PLUS RF FI				1.737,82	3.219,7613	5.595.374,30	1,64%
BRWST4CTF007	WESTERN ASSET PREV INFLATION TOTAL RF FI				11.413,76	3.040,3535	34.701.855,26	10,19%
BRWTR2CTF002	WA MACRO OPPORTUNITIES FIM NO EXTERIOR				10.773,40	1.181,1633	12.725.143,71	3,74%
						Total FI:	329.696.542,95	96,78%
						Total Renda Fixa:	329.697.543,02	96,78%
						Total:	340.676.663,70	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.