



FT-REAL Franklin Templeton Deuda Tasa Real, S. A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda  
CARTERA DE VALORES AL 31 mayo, 2017

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>TITULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSION EN TITULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
S	UDIBONO	171214	Aaa.mx	5,327	3,121,664.94	0.44
S	UDIBONO	190613	Aaa.mx	82,717	49,221,777.86	6.86
S	UDIBONO	201210	Aaa.mx	50,760	28,820,546.40	4.02
S	UDIBONO	220609	Aaa.mx	69,910	38,213,531.39	5.33
S	UDIBONO	251204	Aaa.mx	76,707	49,014,441.37	6.83
S	UDIBONO	281130	mxAAA	9,245	5,733,251.30	0.80
S	UDIBONO	351122	Aaa.mx	33,648	22,183,049.70	3.09
S	UDIBONO	401115	Aaa.mx	59,828	36,789,494.07	5.13
S	UDIBONO	461108	Aaa.mx	34,855	21,504,168.47	3.00
<b>TITULOS BANCARIOS</b>						
F	BANOBRA	U06008	mxAAA	13,275	7,917,452.96	1.10
94	BACOMER	07U	Aaa.mx	11,298	6,745,251.07	0.94
<b>PAPEL PRIVADO</b>						
D6	SANTAN	3-07	BBB+	11	16,426,809.60	2.29
90	PAMMCB	14U	mxAAA	43,274	25,666,289.53	3.58
91	DOIXCB	15U	HR AA+	6,961	3,162,850.63	0.44
91	FICCB	08U	Aa1.mx	2,489	1,639,229.61	0.23
91	FICCB	09U	Aa1.mx	8,139	2,182,659.23	0.30
91	FUNO	16U	AAA(mex)	31,286	17,654,279.33	2.46
91	LIVEPOL	10U	mxAAA	16,446	9,487,211.31	1.32
91	RDO	12U	mxAAA	27,242	15,396,709.02	2.15
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	4,075	968,240.86	0.13
95	CDVITOT	12U	mxAAA	4,539	1,239,011.83	0.17
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	761	217,605.82	0.03
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	3,554	1,090,292.15	0.15
95	CDVITOT	15U	mxAAA	39,184	15,679,291.79	2.19
95	CEDEVIS	06-3U	mxAAA	13,376	921,906.66	0.13
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	1,168	205,190.03	0.03
95	CEDEVIS	0810U	mxAAA	12,212	4,634,010.13	0.65
95	CEDEVIS	08-2U	mxAAA	13,443	4,390,165.46	0.61
95	CEDEVIS	08-4U	mxAAA	2,500	1,186,150.58	0.17
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	4,477	1,752,484.60	0.24
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	45,900	8,875,317.13	1.24
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	35,212	10,012,733.61	1.40
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	5,781	1,698,644.83	0.24
95	CEDEVIS	13U	AAA(mex)	1,485	409,074.33	0.06
95	CFE	15U	Aa1.mx	25,294	14,531,454.47	2.03
95	CFE	09U	Aa1.mx	64,347	9,506,414.66	1.32
95	HITOTAL	10U	AAA(mex)	89,562	5,190,161.66	0.72
95	PEMEX	10U	Aa3.mx	27,405	15,740,228.40	2.19
95	PEMEX	12U	Aa3.mx	2,858	1,368,096.90	0.19
95	PEMEX	14U	AAA(mex)	24,029	12,933,926.67	1.80
95	PEMEX	15U	AAA(mex)	20,517	11,316,680.98	1.58
95	TFOVICB	15U	AAA(mex)	37,409	17,734,593.08	2.47
95	TFOVICB	15-2U	AAA(mex)	39,565	19,069,636.98	2.66
95	TFOVICB	16U	AAA(mex)	46,929	24,640,425.67	3.43
95	TFOVIS	10-2U	AAA(mex)	57,364	4,277,781.59	0.60
95	TFOVIS	11U	AAA(mex)	10,605	1,877,223.73	0.26
95	TFOVIS	11-2U	AAA(mex)	46,394	5,888,866.74	0.82
95	TFOVIS	11-3U	AAA(mex)	9,620	1,917,530.69	0.27
95	TFOVIS	12U	AAA(mex)	8,573	2,155,349.89	0.30
95	TFOVIS	12-2U	AAA(mex)	31,932	7,952,359.36	1.11
95	TFOVIS	12-3U	AAA(mex)	14,000	4,082,373.05	0.57
95	TFOVIS	13U	AAA(mex)	36,160	12,528,738.50	1.75
95	TFOVIS	13-2U	AAA(mex)	16,826	4,851,140.93	0.68
95	TFOVIS	13-3U	AAA(mex)	34,778	11,900,352.56	1.66
95	TFOVIS	14U	AAA(mex)	25,138	10,192,376.93	1.42
95	TFOVIS	14-2U	AAA(mex)	42,955	18,206,097.37	2.54
95	TFOVIS	14-3U	AAA(mex)	27,922	11,674,712.04	1.63
<b>TOTAL INVERSION EN TITULOS DE DEUDA</b>					643,697,310.45	89.70
<b>TOTAL TITULOS PARA NEGOCIAR</b>					643,697,310.45	89.70
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADO</b>						
M	BONOS	181213	HR AAA	698,396	73,903,742.80	10.30
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					73,903,742.80	10.30
<b>TOTAL DE INVERSION EN VALORES</b>					717,601,053.25	100.00

**CLASIFICACIÓN**

LARGO PLAZO ESPECIALIZADA EN VALORES DE TASA REAL

**CALIFICACIÓN**  
AAA/6(mex) F

**VaR Promedio**  
1.069%

**Limite de VaR**  
4.000%

Método Histórico 1 días con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.

HUGO PETRICIOLI CASTELLON

Este documento ha sido elaborado por Franklin Templeton Asset Management México, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión con la finalidad de proporcionar a los inversionistas información financiera general relativa a los fondos y los activos objeto de inversión en los que invierten en términos de lo requerido por la regulación aplicable en los Estados Unidos Mexicanos. El contenido del presente documento proviene de fuentes consideradas como fidedignas, sin embargo, no se ofrece garantía alguna, ni representa una sugerencia para la toma de decisiones en materia de inversión. Franklin Templeton Asset Management México, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión no asume ningún tipo de responsabilidad en caso de que el presente documento sea interpretado como recomendación de compra o venta de cualquiera de los activos objeto de inversión que en el mismo se mencionan. Este documento no podrá ser reproducido o utilizado parcial o totalmente por ningún medio, ni ser distribuido, citado o divulgado sin el permiso previo por escrito de Franklin Templeton Asset Management México, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión. La información mostrada en la lista de Principales tenencias del Fondo Subyacente, son los últimos datos conocidos a la fecha. Cualquier duda favor de referirse a nuestra sección de Información Importante en la siguiente dirección electrónica: [www.franklintempleton.com.mx](http://www.franklintempleton.com.mx)