

## FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

## CORTO PLAZO

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>BPAS 182</b>			<b>66,667,904</b>	<b>4.84 %</b>
IS	BPA182	170629	AAA(mex)	41,047,102	2.98 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	25,620,802	1.86 %
	<b>Bondes D</b>			<b>540,353,009</b>	<b>39.25 %</b>
LD	BONDES D	181011	AAA(mex)	99,983,969	7.26 %
LD	BONDES D	170622	AAA(mex)	80,103,654	5.82 %
LD	BONDES D	170824	AAA(mex)	70,354,705	5.11 %
LD	BONDES D	171019	AAA(mex)	60,299,041	4.38 %
LD	BONDES D	180419	AAA(mex)	60,115,702	4.37 %
LD	BONDES D	180927	AAA(mex)	45,110,423	3.28 %
LD	BONDES D	171221	AAA(mex)	40,143,823	2.92 %
LD	BONDES D	181213	AAA(mex)	30,602,757	2.22 %
LD	BONDES D	171005	AAA(mex)	20,049,254	1.46 %
LD	BONDES D	180328	AAA(mex)	18,563,242	1.35 %
LD	BONDES D	180614	AAA(mex)	15,026,440	1.09 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago Trim.</b>			<b>176,959,082</b>	<b>12.85 %</b>
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	70,634,355	5.13 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	50,630,747	3.68 %
IQ	BPAG91	170629	AAA(mex)	40,451,314	2.94 %
IQ	BPAG91	170831	AAA(mex)	15,242,667	1.11 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago mensual</b>			<b>230,809,017</b>	<b>16.76 %</b>
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	70,262,280	5.10 %
IM	BPAG28	170727	AAA(mex)	60,307,342	4.38 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	55,181,074	4.01 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	45,058,322	3.27 %
	<b>Renortos</b>			<b>361,983,335</b>	<b>26.29 %</b>
LD	BONDES D	191003	AAA(mex)	141,941,802	10.31 %
IQ	BPAG91	200820	AAA(mex)	120,022,680	8.72 %
LD	BONDES D	171019	AAA(mex)	100,018,853	7.26 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,376,772,348</b>	<b>100.00 %</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,373,755,017</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>3,434,388</b>	<b>0.25 %</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>73,503</b>	<b>0.01 %</b>
	<b>Cartera al:</b>		5/31/2017		

EL VALOR EN RIESGO (VAR POR SUS SIGLAS EN INGLÉS) ES CALCULADO UTILIZANDO EL MÉTODO MONTECARLO, CONSIDERANDO 250 PERÍODOS DE HISTORIA Y GENERANDO 1000 ESCENARIOS DE LOS PRINCIPALES FACTORES DE RIESGO QUE AFECTAN EL VALOR DE LOS ACTIVOS QUE COMPONEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 1 DÍA.