

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BPAS 182			99,565,644	1.06 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	89,303,868	0.95 %
IS	BPA182	170629	AAA(mex)	10,261,776	0.11 %
	Bondes D			3,201,399,772	34.09 %
LD	BONDES D	170622	AAA(mex)	420,544,181	4.48 %
LD	BONDES D	181011	AAA(mex)	399,935,876	4.26 %
LD	BONDES D	180419	AAA(mex)	394,957,655	4.21 %
LD	BONDES D	171005	AAA(mex)	389,502,880	4.15 %
LD	BONDES D	170824	AAA(mex)	366,849,532	3.91 %
LD	BONDES D	180104	AAA(mex)	340,324,629	3.62 %
LD	BONDES D	180328	AAA(mex)	338,791,681	3.61 %
LD	BONDES D	171221	AAA(mex)	164,282,674	1.75 %
LD	BONDES D	181213	AAA(mex)	140,479,963	1.50 %
LD	BONDES D	180927	AAA(mex)	140,343,538	1.49 %
LD	BONDES D	170706	AAA(mex)	70,485,753	0.75 %
LD	BONDES D	180614	AAA(mex)	34,901,412	0.37 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			1,410,360,517	15.02 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	369,604,449	3.94 %
IQ	BPAG91	170629	AAA(mex)	320,576,663	3.41 %
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	220,456,483	2.35 %
IQ	BPAG91	170831	AAA(mex)	212,937,513	2.27 %
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	186,676,509	1.99 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	80,033,917	0.85 %
IQ	BPAG91	180201	AAA(mex)	20,074,982	0.21 %
	Bonos Prot. Ahorro pago mensual			1,455,158,850	15.50 %
IM	BPAG28	170727	AAA(mex)	492,509,961	5.25 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	326,069,981	3.47 %
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	291,086,587	3.10 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	230,298,089	2.45 %
IM	BPAG28	180222	AAA(mex)	115,194,232	1.23 %
	Reportos			3,223,549,881	34.33 %
LD	BONDES D	191003	AAA(mex)	901,092,350	9.60 %
LD	BONDES D	171019	AAA(mex)	872,182,487	9.29 %
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	795,145,113	8.47 %
IM	BPAG28	191121	AAA(mex)	358,080,349	3.81 %
IQ	BPAG91	181220	AAA(mex)	297,049,582	3.16 %
	TOTAL CARTERA			9,390,034,664	100.00 %
	ACTIVO NETO			9,381,325,164	
	VAR ESTABLECIDO \$			2,814,398	0.03 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			350,494	0.00 %
	Cartera al:		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.