

PRINCIPAL DEUDA R, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION DE INSTRUMENTOS DE DEUDA

LARGO PLAZO TASA REAL

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BPAS 182			71,402,006	10.07 %
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	20,121,265	2.84 %
IS	BPA182	180104	AAA(mex)	20,103,987	2.83 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	18,097,217	2.55 %
IS	BPA182	190704	AAA(mex)	13,079,536	1.84 %
	Udibonos	UDIS		636,435,116	89.71 %
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	264,146,898	37.23 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	176,131,227	24.83 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	149,629,855	21.09 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	46,527,136	6.56 %
	Renortos			1,571,109	0.22 %
LD	BONDESD	191003	AAA(mex)	1,571,109	0.22 %
	TOTAL CARTERA			709,408,231	100.00 %
	ACTIVO NETO			708,917,724	
	VAR ESTABLECIDO \$			3,544,589	0.50 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			1,630,304	0.22 %
	Cartera al:		7/31/2017		

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.