

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			72,248,646	9.66 %
IS	BPA182	180104	AAA(mex)	20,351,224	2.72 %
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	20,343,168	2.72 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	18,317,968	2.45 %
IS	BPA182	190704	AAA(mex)	13,236,285	1.77 %
	Udibonos	UDIS		661,634,959	88.44 %
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	237,545,570	31.75 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	222,385,099	29.73 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	151,212,420	20.21 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	47,373,496	6.33 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	3,118,373	0.42 %
	Reportos			14,198,697	1.90 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	14,198,697	1.90 %
	TOTAL CARTERA			748,082,301	100.00 %
	ACTIVO NETO			747,652,609	
	VAR ESTABLECIDO \$			3,738,263	0.50 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			796,270	0.11 %
	Cartera al:		9/29/2017		

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.