

PRINCIPAL DEUDA R, SA DE CV FONDO DE INVERSION DE INSTRUMENTOS DE DEUDA

LARGO PLAZO TASA REAL

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BPAS 182			77,919,875	10.51 %
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	20,511,332	2.77 %
IS	BPA182	180104	AAA(mex)	20,497,803	2.76 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	18,446,978	2.49 %
IS	BPA182	190704	AAA(mex)	13,332,874	1.80 %
IS	BPA182	170629	AAA(mex)	5,130,888	0.69 %
	Udibonos	UDIS		652,707,117	88.03 %
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	234,355,216	31.61 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	190,296,390	25.66 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	185,224,814	24.98 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	22,599,048	3.05 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	20,231,648	2.73 %
	Reportos			10,849,911	1.46 %
LD	BONDESD	191003	AAA(mex)	10,849,911	1.46 %
	TOTAL CARTERA			741,476,902	100.00 %
	ACTIVO NETO			740,909,523	
	VAR ESTABLECIDO \$			3,704,548	0.50 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			1,691,428	0.23 %
	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.