

## FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

## MEDIANO PLAZO

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>BPAS 182</b>			<b>203,991,408</b>	<b>8.75 %</b>
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	69,738,530	2.99 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	56,365,765	2.42 %
IS	BPA182	190411	AAA(mex)	40,348,326	1.73 %
IS	BPA182	170629	AAA(mex)	22,165,435	0.95 %
IS	BPA182	180104	AAA(mex)	15,373,352	0.66 %
	<b>Bondes D</b>			<b>275,656,491</b>	<b>11.82 %</b>
LD	BONDES D	171005	AAA(mex)	120,295,526	5.16 %
LD	BONDES D	181213	AAA(mex)	70,239,982	3.01 %
LD	BONDES D	180614	AAA(mex)	70,123,388	3.01 %
LD	BONDES D	181011	AAA(mex)	14,997,595	0.64 %
	<b>Bonos Gob. Fed. Tasa fija</b>			<b>12,986,033</b>	<b>0.56 %</b>
M	BONOS	270603	AAA(mex)	12,986,033	0.56 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago Trim.</b>			<b>622,998,944</b>	<b>26.72 %</b>
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	96,275,119	4.13 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	90,038,156	3.86 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	86,072,269	3.69 %
IQ	BPAG91	170629	AAA(mex)	80,902,628	3.47 %
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	80,420,443	3.45 %
IQ	BPAG91	170831	AAA(mex)	73,164,800	3.14 %
IQ	BPAG91	181220	AAA(mex)	65,672,418	2.82 %
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	50,453,111	2.16 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago mensual</b>			<b>245,703,113</b>	<b>10.54 %</b>
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	115,430,888	4.95 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	70,090,723	3.01 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	50,164,613	2.15 %
IM	BPAG28	180222	AAA(mex)	10,016,890	0.43 %
	<b>Tit. Deuda de Org. Multilat.</b>			<b>19,993,057</b>	<b>0.86 %</b>
JI	CABEI	1-16	mxAAA	19,993,057	0.86 %
	<b>Udibonos UDIS</b>			<b>313,358,042</b>	<b>13.44 %</b>
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	97,343,109	4.18 %
S	UDIBONO	171214	AAA(mex)	70,036,753	3.00 %
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	50,012,021	2.15 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	35,173,444	1.51 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	25,759,579	1.10 %
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	24,860,259	1.07 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	10,172,878	0.44 %
	<b>Valores paraestatales Rendim.</b>			<b>202,921,462</b>	<b>8.70 %</b>
95	CFE	14	Aa1.mx	44,789,811	1.92 %
95	PEMEX	12	Aa3.mx	27,094,488	1.16 %
95	CEDEVIS	0810U	AAA(mex)	24,484,133	1.05 %
95	FEFA	17	AAA(mex)	22,060,718	0.95 %
95	FEFA	17-2	AAA(mex)	22,057,862	0.95 %
95	PEMEX	14	Aa3.mx	19,663,262	0.84 %
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	15,497,242	0.66 %
95	FEFA	14	AAA(mex)	13,987,657	0.60 %
95	CFE	15	Aa1.mx	7,634,064	0.33 %
95	FEFA	16-3	AAA(mex)	5,652,225	0.24 %
	<b>Reportos</b>			<b>433,796,027</b>	<b>18.61 %</b>
LD	BONDES D	171019	AAA(mex)	170,032,141	7.29 %
IQ	BPAG91	211223	AAA(mex)	126,857,953	5.44 %
LD	BONDES D	191003	AAA(mex)	93,731,644	4.02 %
IQ	BPAG91	200820	AAA(mex)	43,174,289	1.85 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>2,331,404,577</b>	<b>100.00 %</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>2,329,769,461</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>8,853,124</b>	<b>0.38 %</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>1,038,345</b>	<b>0.05 %</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 COMPOENEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 7 DÍAS