



**FT-LIQU FRANKLIN TEMPLETON DEUDA CORTO PLAZO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 12 octubre, 2017**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TITULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
IQ	BPAG91	180816	mxAAA	2,800,000	282,925,630.40	11.86
IQ	BPAG91	181018	mxAAA	1,350,000	137,121,535.80	5.75
IQ	BPAG91	181220	mxAAA	2,000,000	200,639,498.00	8.41
IQ	BPAG91	190417	mxAAA	1,500,000	152,284,099.50	6.38
IQ	BPAG91	190822	mxAAA	2,000,000	201,495,808.00	8.45
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	1,300,000	130,213,220.80	5.46
LD	BONDESD	180419	mxAAA	150,000	15,015,522.90	0.63
LD	BONDESD	180614	mxAAA	660,968	66,156,450.38	2.77
LD	BONDESD	180816	mxAAA	690,000	68,967,785.28	2.89
LD	BONDESD	180927	mxAAA	847,591	84,942,855.19	3.56
LD	BONDESD	181213	mxAAA	1,370,000	137,430,985.56	5.76
LD	BONDESD	190627	mxAAA	709,685	71,118,215.15	2.98
LD	BONDESD	190808	mxAAA	530,000	52,947,598.37	2.22
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,601,259,205.33	67.12
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,601,259,205.33	67.12
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	220512	mxAAA	7,886,186	784,389,796.34	32.88
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					784,389,796.34	32.88
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					2,385,649,001.67	100.00

**CLASIFICACIÓN
CORTO PLAZO**

CALIFICACIÓN
AAAf/S2(mex)

VaR Promedio
0.050%

Límite de VaR
0.100%

Método Histórico 1 días con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.

HUGO PETRICIOLI CASTELLON