



**FT-LIQU FRANKLIN TEMPLETON DEUDA CORTO PLAZO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 10 agosto, 2017**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
IQ	BPAG91	190417	mxAAA	1,000,000	100,207,027.00	9.62
IQ	BPAG91	190822	mxAAA	1,000,000	101,234,389.00	9.72
LD	BONDES	170824	mxAAA	60,000	6,017,540.94	0.58
LD	BONDES	171005	mxAAA	150,000	15,001,847.25	1.44
LD	BONDES	180419	mxAAA	150,000	14,994,987.75	1.44
LD	BONDES	180614	mxAAA	660,968	66,064,466.11	6.34
LD	BONDES	180816	mxAAA	690,000	69,237,412.44	6.65
LD	BONDES	180927	mxAAA	847,591	84,805,199.63	8.14
LD	BONDES	181213	mxAAA	1,370,000	137,214,262.52	13.18
LD	BONDES	190627	mxAAA	709,685	71,002,392.43	6.82
LD	BONDES	190808	mxAAA	530,000	52,871,211.59	5.08
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					718,650,736.66	69.01
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					718,650,736.66	69.01
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	3,206,684	322,745,614.68	30.99
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					322,745,614.68	30.99
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,041,396,351.34	100.00

**CLASIFICACIÓN
CORTO PLAZO**

CALIFICACIÓN
AAAf/S2(mex)

VaR Promedio
0.027%

Limite de VaR
0.100%

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

HUGO PETRICIOLI CASTELLON