

## FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

## CORTO PLAZO

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>BPAS 182</b>			<b>66,857,045</b>	<b>4.78 %</b>
IS	BPA182	170629	AAA(mex)	41,158,466	2.94 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	25,698,580	1.84 %
	<b>Bondes D</b>			<b>540,118,146</b>	<b>38.64 %</b>
LD	BONDESD	181011	AAA(mex)	100,270,834	7.17 %
LD	BONDESD	170622	AAA(mex)	80,331,013	5.75 %
LD	BONDESD	170824	AAA(mex)	70,191,857	5.02 %
LD	BONDESD	171019	AAA(mex)	60,159,570	4.30 %
LD	BONDESD	180419	AAA(mex)	59,970,095	4.29 %
LD	BONDESD	180927	AAA(mex)	45,005,894	3.22 %
LD	BONDESD	171221	AAA(mex)	40,048,828	2.87 %
LD	BONDESD	181213	AAA(mex)	30,532,620	2.18 %
LD	BONDESD	171005	AAA(mex)	20,000,887	1.43 %
LD	BONDESD	180328	AAA(mex)	18,616,188	1.33 %
LD	BONDESD	180614	AAA(mex)	14,990,359	1.07 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago Trim.</b>			<b>176,415,701</b>	<b>12.62 %</b>
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	70,847,731	5.07 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	49,950,864	3.57 %
IQ	BPAG91	170629	AAA(mex)	40,570,749	2.90 %
IQ	BPAG91	170831	AAA(mex)	15,046,358	1.08 %
	<b>Bonos Prot. Ahorro pago mensual</b>			<b>230,279,314</b>	<b>16.48 %</b>
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	70,096,226	5.02 %
IM	BPAG28	170727	AAA(mex)	60,163,765	4.30 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	55,059,978	3.94 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	44,959,347	3.22 %
	<b>Renortos</b>			<b>383,982,749</b>	<b>27.47 %</b>
LD	BONDESD	191003	AAA(mex)	162,727,029	11.64 %
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	120,022,992	8.59 %
LD	BONDESD	190808	AAA(mex)	101,232,728	7.24 %
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,397,652,955</b>	<b>100.00 %</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,395,880,412</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>3,489,701</b>	<b>0.25 %</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>47,035</b>	<b>0.00 %</b>
	<b>Cartera al:</b>		6/15/2017		

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.