

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BPAS 182			99,864,586	1.11 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	89,574,970	0.99 %
IS	BPA182	170629	AAA(mex)	10,289,616	0.11 %
	Bondes D			3,201,643,863	35.46 %
LD	BONDES D	170622	AAA(mex)	421,737,817	4.67 %
LD	BONDES D	181011	AAA(mex)	401,083,336	4.44 %
LD	BONDES D	180419	AAA(mex)	394,001,028	4.36 %
LD	BONDES D	171005	AAA(mex)	388,563,228	4.30 %
LD	BONDES D	170824	AAA(mex)	366,000,399	4.05 %
LD	BONDES D	180104	AAA(mex)	341,293,516	3.78 %
LD	BONDES D	180328	AAA(mex)	339,757,977	3.76 %
LD	BONDES D	171221	AAA(mex)	163,893,923	1.82 %
LD	BONDES D	181213	AAA(mex)	140,158,004	1.55 %
LD	BONDES D	180927	AAA(mex)	140,018,337	1.55 %
LD	BONDES D	170706	AAA(mex)	70,318,690	0.78 %
LD	BONDES D	180614	AAA(mex)	34,817,607	0.39 %
	Bonos Prot. Ahorro pago Trim.			1,405,163,806	15.56 %
IQ	BPAG91	180614	AAA(mex)	364,641,304	4.04 %
IQ	BPAG91	170629	AAA(mex)	321,523,184	3.56 %
IQ	BPAG91	171109	AAA(mex)	221,139,884	2.45 %
IQ	BPAG91	170831	AAA(mex)	210,195,113	2.33 %
IQ	BPAG91	180405	AAA(mex)	187,240,431	2.07 %
IQ	BPAG91	180816	AAA(mex)	80,287,047	0.89 %
IQ	BPAG91	180201	AAA(mex)	20,136,843	0.22 %
	Bonos Prot. Ahorro pago mensual			1,451,823,755	16.08 %
IM	BPAG28	170727	AAA(mex)	491,337,411	5.44 %
IM	BPAG28	171123	AAA(mex)	325,354,413	3.60 %
IM	BPAG28	180726	AAA(mex)	290,398,649	3.22 %
IM	BPAG28	180517	AAA(mex)	229,792,216	2.54 %
IM	BPAG28	180222	AAA(mex)	114,941,067	1.27 %
	Reportos			2,871,523,883	31.80 %
IQ	BPAG91	181018	AAA(mex)	1,210,231,840	13.40 %
LD	BONDES D	191003	AAA(mex)	978,938,800	10.84 %
LD	BONDES D	190808	AAA(mex)	682,353,243	7.56 %
	TOTAL CARTERA			9,030,019,893	100.00 %
	ACTIVO NETO			9,022,821,768	
	VAR ESTABLECIDO \$			2,706,847	0.03 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			233,554	0.00 %
	Cartera al:		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.