

PRINCIPAL DEUDA R, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION DE INSTRUMENTOS DE DEUDA

LARGO PLAZO TASA REAL

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BPAS 182			72,400	9.90 %
IS	BPA182	180104	AAA(mex)	20,393	2.79 %
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	20,386	2.79 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	18,357	2.51 %
	VARIOS			13,264	1.81 %
	Udibonos	UDIS		623,921	85.30 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	221,913	30.34 %
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	205,128	28.04 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	150,365	20.56 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	46,514	6.36 %
	Renortos			35,123	4.80 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	35,123	4.80 %
	TOTAL CARTERA			731,445	100.00 %
	ACTIVO NETO			742,509	
	VAR ESTABLECIDO \$			3,713	0.50 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			964	0.13 %
	Cartera al:		10/12/2017		

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.