

PRINCIPAL DEUDA R, SA DE CV FONDO DE INVERSION DE INSTRUMENTOS DE DEUDA

LARGO PLAZO TASA REAL

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BPAS 182			78,154,090	10.08 %
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	20,573,210	2.65 %
IS	BPA182	180104	AAA(mex)	20,559,946	2.65 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	18,502,977	2.39 %
IS	BPA182	190704	AAA(mex)	13,373,148	1.73 %
IS	BPA182	170629	AAA(mex)	5,144,808	0.66 %
	Udibonos			668,843,308	86.30 %
	UDIS				
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	229,827,344	29.65 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	209,135,023	26.98 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	203,089,944	26.20 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	26,790,997	3.46 %
	Reportos			28,044,873	3.62 %
LD	BONDESD	191003	AAA(mex)	28,044,873	3.62 %
	TOTAL CARTERA			775,042,271	100.00 %
	ACTIVO NETO			774,529,759	
	VAR ESTABLECIDO \$			3,872,649	0.50 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			1,897,759	0.24 %
	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.