

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			71,527,311	10.10 %
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	20,154,551	2.85 %
IS	BPA182	180104	AAA(mex)	20,144,158	2.84 %
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	18,127,398	2.56 %
IS	BPA182	190704	AAA(mex)	13,101,203	1.85 %
	Udibonos UDIS			633,065,079	89.37 %
S	UDIBONO	190613	AAA(mex)	239,709,307	33.84 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	176,691,665	24.94 %
S	UDIBONO	201210	AAA(mex)	150,115,823	21.19 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	46,629,006	6.58 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	19,919,278	2.81 %
	Reportos			3,797,979	0.54 %
LD	BONDESD	170824	AAA(mex)	3,797,979	0.54 %
	TOTAL CARTERA			708,390,369	100.00 %
	ACTIVO NETO			708,061,987	
	VAR ESTABLECIDO \$			3,540,310	0.50 %
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			1,319,287	0.19 %
	Cartera al:		8/10/2017		

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 COMPOENEN LA CARTERA. EL NIVEL DE CONFIANZA REPORTADO ES DEL 95% CON UN HORIZONTE DE 1 DÍA.