

**CARTERA SEMANAL
ST&ER-7
19 MAYO 2016**



INSTRUMENTO		CALIFICACIÓN		VALOR MERCADO	%
TÍTULOS RECIBIDOS EN REPORTE				1,004,351,298	19.109%
IS	BPA182	180412	AAA(mex)	63,128,851	1.201%
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	304,195,260	5.788%
IS	BPA182	190103	AAA(mex)	457,393,705	8.702%
LD	BONDES	190411	HR AAA	179,633,481	3.418%
TÍTULOS EXTRANJEROS EMPRESAS MEXICANAS				1,943,800	0.037%
JE	AMX	0619	Aaa.mx	1,943,800	0.037%
BONOS DE PROTECCION AL AHORRO				439,788,129	8.368%
IS	BPA182	180705	AAA(mex)	121,578,012	2.313%
IS	BPA182	200130	AAA(mex)	192,260,922	3.658%
IS	VARIOS			125,949,195	2.396%
CERTIFICADOS BURSATILES DE INDEMNIZACION CARRETERA				79,961,097	1.521%
2U	CBIC003	210128	mxAAA	79,961,097	1.521%
CERTIFICADO BURSATIL DE EMPRESAS PRIVADAS				89,319,047	1.699%
91	VARIOS			89,319,047	1.699%
CERTIFICADO BURSATIL BANCARIO				18,351,414	0.349%
94	VARIOS			18,351,414	0.349%
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				4,096,550	0.078%
JL	CABEI	1-14	mxAAA	4,096,550	0.078%
BONOS				2,912,429,017	55.413%
M	BONOS	180614	Aaa.mx	169,587,593	3.227%
M	BONOS	181213	HR AAA	545,309,978	10.375%
M	BONOS	191211	Aaa.mx	199,708,050	3.800%
M	BONOS	200611	HR AAA	136,185,460	2.591%
M	BONOS	210610	HR AAA	109,000,018	2.074%
M	BONOS	220609	Aaa.mx	243,677,179	4.636%
M	BONOS	241205	HR AAA	635,123,367	12.084%
M	BONOS	310529	HR AAA	340,401,175	6.477%
M	BONOS	421113	Aaa.mx	439,600,011	8.364%
M	VARIOS			93,836,186	1.785%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS				562,632,921	10.705%
S	UDIBONO	160616	Aaa.mx	165,144,039	3.142%
S	UDIBONO	401115	Aaa.mx	192,875,101	3.670%
S	VARIOS			204,613,782	3.893%
INVERSION EN DOLARES				1,990,443	0.038%
CHD	VARIOS			1,990,443	0.038%
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				60,741,118	1.156%
D8	VARIOS			60,741,118	1.156%
VALORES PARAESTATALES A RENDIM.				76,897,624	1.463%
95	VARIOS			76,897,624	1.463%
OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS - SWAPS				-3,892,056	-0.074%
SWP	VARIOS			-3,892,056	-0.074%
APORTACIONES MARGEN-OPERACIONES DERIVADOS				7,282,387	0.139%
AIM	VARIOS			26,000	0.000%
EAIM	VARIOS			7,256,387	0.138%
TOTAL CARTERA				5,255,892,790	100.000%
VALOR DEL ACTIVO NETO				5,436,667,161	
VAR ESTABLECIDO					1.349%
VAR OBSERVADO (Promedio)					0.398%

Cartera al 19/05/2016 FONDO SANTANDER DE DEUDA RECURSO, S.A. DE C.V., FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

El Valor en Riesgo se estima utilizando la metodología de Simulación Histórica de 500 escenarios con un nivel de confianza del 95% a dos colas. El VaR Establecido es a un horizonte de 1 día.

Clasificación: Largo plazo

Calificación:

Escala homogénea AAA/6S&P