



**FT-REAL Franklin Templeton Deuda Tasa Real, S. A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda
CARTERA DE VALORES AL 19 mayo, 2016**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
S	UDIBONO	160616	Aaa.mx	14,077	7,786,301.34	3.89
S	UDIBONO	171214	Aaa.mx	10,903	6,188,168.47	3.09
S	UDIBONO	190613	Aaa.mx	13,582	7,895,873.57	3.95
S	UDIBONO	201210	Aaa.mx	17,122	9,375,647.36	4.69
S	UDIBONO	220609	Aaa.mx	19,431	10,123,494.49	5.06
S	UDIBONO	251204	Aaa.mx	21,824	13,362,766.56	6.68
S	UDIBONO	351122	Aaa.mx	3,315	2,072,416.34	1.04
S	UDIBONO	401115	Aaa.mx	6,305	3,669,870.08	1.83
S	UDIBONO	461108	Aaa.mx	2,484	1,443,305.63	0.72
TÍTULOS BANCARIOS						
94	BACOMER	07U	AAA(mex)	11,298	6,402,027.47	3.20
PAPEL PRIVADO						
90	PAMMCB	14U	HR AAA	14,787	8,488,445.23	4.24
91	DOIXCB	15U	mxAAA	912	483,759.55	0.24
91	FICCB	08U	HR AAA	509	336,686.19	0.17
91	FUNO	16U	AAA(mex)	11,138	5,967,831.01	2.98
91	LIVEPOL	10U	AAA(mex)	5,647	3,207,218.37	1.60
91	RCO	12U	AAA(mex)	8,683	4,493,063.41	2.25
95	CDVITOT	11-3U	AAA(mex)	180	47,748.17	0.02
95	CDVITOT	12U	AAA(mex)	190	57,903.44	0.03
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	146	45,387.13	0.02
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	970	382,272.67	0.19
95	CDVITOT	15U	mxAAA	14,540	7,135,611.07	3.57
95	CEDEVIS	06-3U	AAA(mex)	12,707	1,259,290.17	0.63
95	CEDEVIS	07-3U	AAA(mex)	1,168	244,236.02	0.12
95	CEDEVIS	0810U	AAA(mex)	12,212	5,651,487.54	2.83
95	CEDEVIS	08-2U	AAA(mex)	3,315	1,276,953.42	0.64
95	CEDEVIS	08-4U	AAA(mex)	2,500	1,332,513.88	0.67
95	CEDEVIS	08-6U	AAA(mex)	4,477	1,988,959.04	0.99
95	CEDEVIS	12U	AAA(mex)	235	74,766.71	0.04
95	CEDEVIS	13U	AAA(mex)	978	297,752.03	0.15
95	CFE	15U	AAA(mex)	9,978	5,513,496.43	2.76
95	CFECB	09U	Aaa.mx	2,080	417,106.30	0.21
95	HITOTAL	10U	AAA(mex)	1,648	90,718.54	0.05
95	PEMEX	10U	Aa3.mx	15,558	8,517,465.76	4.26
95	PEMEX	12U	Aa3.mx	1,615	722,338.15	0.36
95	PEMEX	14U	Aa3.mx	10,633	5,301,446.05	2.65
95	PEMEX	15U	Aa3.mx	12,689	6,470,023.00	3.24
95	TFOVICB	15U	mxAAA	13,562	6,807,174.21	3.40
95	TFOVICB	15-2U	mxAAA	3,459	1,773,394.93	0.89
95	TFOVIS	11U	AAA(mex)	10,605	2,523,001.91	1.26
95	TFOVIS	11-2U	AAA(mex)	23,600	4,709,817.28	2.35
95	TFOVIS	11-3U	AAA(mex)	257	66,961.50	0.03
95	TFOVIS	12U	AAA(mex)	190	58,692.98	0.03
95	TFOVIS	12-2U	AAA(mex)	17,199	5,388,761.67	2.69
95	TFOVIS	12-3U	AAA(mex)	14,000	4,757,830.06	2.38
95	TFOVIS	13U	AAA(mex)	17,322	6,717,643.30	3.36
95	TFOVIS	13-2U	AAA(mex)	11,002	3,886,120.19	1.94
95	TFOVIS	13-3U	AAA(mex)	18,755	7,418,998.90	3.71
95	TFOVIS	14U	AAA(mex)	292	132,367.54	0.07
95	TFOVIS	14-3U	AAA(mex)	2,732	1,257,998.19	0.63
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					183,623,013.25	91.81
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					183,623,013.25	91.81
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	170629	AAA(mex)	163,176	16,376,486.64	8.19
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					16,376,486.64	8.19
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					199,999,499.89	100.00

CLASIFICACIÓN

LARGO PLAZO ESPECIALIZADA EN VALORES DE TASA REAL

CALIFICACIÓN
AAA/6(mex)

VaR Promedio
1.008%

Límite de VaR
4.000%

Método Histórico 1 días con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.

HUGO PETRICIOLI CASTELLON