

**FT-REAL FRANKLIN TEMPLETON DEUDA TASA REAL, S. A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda
CARTERA DE VALORES AL 16 MAYO, 2024
Discrecional en Tasas**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	501103	mxAAA	282,738	201,209,362.51	10.12
S	UDIBONO	311127	mxAAA	232,025	163,189,577.34	8.21
S	UDIBONO	351122	mxAAA	197,328	155,427,988.93	7.81
S	UDIBONO	281130	mxAAA	196,091	153,327,613.16	7.71
S	UDIBONO	401115	mxAAA	184,942	136,554,653.41	6.87
S	UDIBONO	461108	mxAAA	169,100	122,271,413.82	6.15
S	UDIBONO	261203	mxAAA	146,734	110,979,444.05	5.58
S	UDIBONO	431112	mxAAA	76,098	49,497,168.74	2.49
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	AUNETCB	24U	AAA(mex)	73,976	62,556,090.89	3.15
91	RCO	18U	mxAAA	65,139	52,663,481.86	2.65
91	FUNO	16U	AAA(mex)	68,701	50,343,592.86	2.53
91	CASCB	22U	AAA(mex)	59,254	45,719,182.95	2.30
91	IPORCB	19U	AAA(mex)	70,267	40,420,955.64	2.03
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	MPUCB	18U	AAA(mex)	86,288	59,334,307.35	2.98
95	CFE	22UV	mxAAA	49,324	40,316,006.22	2.03
95				673,162	183,273,783.58	9.22
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ESTADOS Y MUNICIPIOS						
90	MYCTACB	18U	mxAAA	89,913	61,089,517.39	3.07
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,688,174,140.70	84.88
REPORTO						
IM	BPAG28	260507	mxAAA	1,436,363	143,288,241.62	7.20
TOTAL REPORTO					143,288,241.62	7.20
OTROS VALORES				301,734	157,394,217.45	7.91
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,988,856,599.77	100.00

	CATEGORÍA IDDIS	
CALIFICACIÓN AAAf/S6(mex)	VaR Promedio 0.698%	Limite de VaR 2.00%

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