

**FT-REAL FRANKLIN TEMPLETON DEUDA TASA REAL, S. A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda**  
**CARTERA DE VALORES AL 14 OCTUBRE, 2021**  
**Discrecional en Tasas**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
S	UDIBONO	220609	mxAAA	300,533	211,014,798.96	12.92
S	UDIBONO	231116	mxAAA	141,337	102,856,309.66	6.30
S	UDIBONO	251204	mxAAA	113,335	87,462,907.73	5.35
S	UDIBONO	281130	mxAAA	148,802	113,806,419.32	6.97
S	UDIBONO	311127	mxAAA	28,400	19,762,045.20	1.21
S	UDIBONO	351122	mxAAA	67,698	55,097,075.89	3.37
S	UDIBONO	401115	mxAAA	123,883	96,357,135.44	5.90
S	UDIBONO	461108	mxAAA	111,546	88,148,696.43	5.40
S	UDIBONO	501103	mxAAA	55,065	43,423,498.28	2.66
<b>TÍTULOS BANCARIOS</b>						
F	BANOBRA	U06008	mxAAA	13,275	9,459,185.44	0.58
2U	SHF002	280929	mxAAA	26,976	8,300,731.98	0.51
91	IPORCB	19U	AA+(mex)	64,071	47,532,454.77	2.91
<b>PAPEL PRIVADO</b>						
90	MYCTACB	18U	mxAAA	89,913	65,720,017.74	4.02
90	PAMMCB	14U	mxAAA	69,598	39,913,844.92	2.44
91	FUNO	16U	AAA(mex)	63,201	44,109,394.99	2.70
91	RCO	12U	mxAAA	60,380	38,800,002.03	2.38
91	RCO	18U	mxAAA	60,522	50,623,790.98	3.10
95	CEDEVIS	08-2U	Aaa.mx	43,241	4,041,463.20	0.25
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	35,212	1,990,404.32	0.12
95	FHIPOCB	17U	AAA(mex)	99,168	42,475,716.90	2.60
95	FONADIN	20-2U	AA-(mex)	28,687	20,071,919.68	1.23
95	HITOTAL	10U	Aaa.mx	210,590	15,254,678.41	0.93
95	MXPUCB	18U	AAA(mex)	86,288	63,421,302.06	3.88
95	TFOVICB	13U	mxAAA	58,000	9,447,689.43	0.58
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	140,735	22,533,394.13	1.38
95	TFOVICB	15U	mxAAA	90,151	32,595,669.35	2.00
95	TFOVICB	15-2U	mxAAA	75,861	31,841,408.13	1.95
95	TFOVICB	16U	AAA(mex)	22,492	8,816,546.73	0.54
95	TFOVICB	20U	AAA(mex)	65,680	39,999,544.62	2.45
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	52,409	4,464,477.75	0.27
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	59,284	15,402,823.79	0.94
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	66,455	19,240,973.80	1.18
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	88,122	22,448,342.98	1.37
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					1,476,434,665.04	90.39
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					1,476,434,665.04	90.39
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
IM	BPAG28	240808	mxAAA	1,575,308	156,908,155.38	9.61
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					156,908,155.38	9.61
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					1,633,342,820.42	100.00

**CATEGORÍA**  
**DISCRECIONAL EN TASAS**

**CALIFICACIÓN**  
AAAf/S6(mex)

**VaR Promedio**  
0.608%

**Límite de VaR**  
4.00%

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