



FRANKLIN TEMPLETON

FT-REAL FRANKLIN TEMPLETON DEUDA TASA REAL, S. A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda
CARTERA DE VALORES AL 31 MAYO, 2024
Discrecional en Tasas

Tipo Valor	Emisora	Serie	Entidad Emisora	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO							
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES							
S	UDIBONO	501103	GOBIERNO MEXICO	mxAAA	240,876	172,879,539.11	9.27
S	UDIBONO	351122	GOBIERNO MEXICO	mxAAA	171,935	135,415,311.04	7.26
S	UDIBONO	311127	GOBIERNO MEXICO	mxAAA	189,143	132,235,072.92	7.09
S	UDIBONO	401115	GOBIERNO MEXICO	mxAAA	157,705	116,063,366.78	6.22
S	UDIBONO	281130	GOBIERNO MEXICO	mxAAA	144,725	112,696,663.69	6.04
S	UDIBONO	461108	GOBIERNO MEXICO	mxAAA	141,547	102,884,306.76	5.52
S	UDIBONO	261203	GOBIERNO MEXICO	mxAAA	133,531	101,129,137.08	5.42
S	UDIBONO	251204	GOBIERNO MEXICO	mxAAA	82,796	66,546,280.02	3.57
S	UDIBONO	431112	GOBIERNO MEXICO	mxAAA	60,598	39,197,833.09	2.10
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS							
94	BANORTE	24UX	BANCO MERCANTIL DEL NORT	AAA.mx	49,377	38,952,672.98	2.09
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS							
91	AUNETCB	24U	AUTOVÍA NECAXA - TIHUATLÁN	AAA(mex)	73,976	62,499,666.37	3.35
91	RCO	18U	RED DE CARRETERAS DE OCC	mxAAA	65,139	52,707,353.24	2.83
91	FUNO	16U	FIBRA UNO ADMINISTRACIÓN	AAA(mex)	68,701	50,581,248.03	2.71
91	CASCB	22U	CONCESIONARIA DE AUTOPISTAS	AAA(mex)	59,254	45,696,920.93	2.45
91	IPORCB	19U	BANCO INVEX, S.A., INSTITUCIÓN	AAA(mex)	70,267	40,541,752.98	2.17
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL							
95	MXPUCB	18U	CIBANCO, S.A. INSTITUCIÓN DE	AAA(mex)	86,288	58,911,120.71	3.16
95	CFE	22UV	COMISION FEDERAL DE ELEC	mxAAA	49,324	38,901,871.65	2.09
95					673,162	179,870,818.06	9.64
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ESTADOS Y MUNICIPIOS							
90	MYCTACB	18U	RED ESTATAL DE AUTOPISTAS	mxAAA	89,913	60,829,388.83	3.26
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO						1,608,540,324.27	86.22
REPORTO							
LF	BONDESF	270318	GOBIERNO MEXICO	mxAAA	1,114,395	111,131,835.36	5.96
TOTAL REPORTO						111,131,835.36	5.96
OTROS VALORES					590,577	145,872,972.83	7.82
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES						1,865,545,132.46	100.00

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN
AAA/IS6(mex)

VaR Promedio
0.735%

Límite de VaR
2.00%

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

HUGO PETRICIOLI CASTELLON

Este documento ha sido elaborado por Franklin Templeton Asset Management México, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión con la finalidad de proporcionar a los inversionistas información financiera general relativa a los fondos y los activos objeto de inversión en los que invierten en términos de lo requerido por la regulación aplicable en los Estados Unidos Mexicanos. El contenido del presente documento proviene de fuentes consideradas como fidedignas, sin embargo, no se ofrece garantía alguna, ni representa una sugerencia para la toma de decisiones en materia de inversión. En caso de requerir la composición de la cartera del Fondo Subyacente, usted podrá consultar esta información dentro de los archivos Factsheets-Reportes Mensuales en el siguiente link: http://www.franklintempleton.com.mx/es_MX/public/fondos/factsheets-folleto-comentarios.page. Franklin Templeton Asset Management México, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión no asume ningún tipo de responsabilidad en caso de que el presente documento sea interpretado como recomendación de compra o venta de cualquiera de los activos objeto de inversión que en el mismo se mencionan. Este documento no podrá ser reproducido o utilizado parcial o totalmente por ningún medio, ni ser distribuido, citado o divulgado sin el permiso previo por escrito de Franklin Templeton Asset Management México, S.A. de C.V., Sociedad Operadora de Fondos de Inversión. La información mostrada en la lista de Principales tenencias del Fondo Subyacente, son los últimos datos conocidos a la fecha. Cualquier duda favor de referirse a nuestra sección de Información importante en la siguiente dirección electrónica: www.franklintempleton.com.mx.