

TEMBIA

SOCIEDAD DE INVERSION DE DEUDA

Largo plazo especializada en valores de deuda emitidos por gobiernos y entidades gubernamentales de todo el mundo, a través de sociedades de inversión.

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
SOC. DE INV. EXTRANJERAS					
56SP	TEMBIA	LX	N/A	535,512	99.941%
				535,512	99.941%
VALORES EN REPORTO					
IT	BPAT	160811	AAA(mex)	314	0.059%
				314	0.059%
TOTAL CARTERA				535,826	100.000%
ACTIVO NETO				549,199	
VAR ESTABLECIDO \$				32,973	6.00%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				16,729	3.13%
Cartera al:					
					30-Dic-11

Método Histórico 28 días con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.

Principales tenencias del Fondo Subyacente (Templeton Global Bond Fund TEMGBIA LX)

Korea Treasury Bond, senior bond, 4.00%, 6/10/12	4.14%
Korea Treasury Bond, 4.25%, 12/10/12	3.33%
Kommuninvest I Sverige AB, senior note, 1.75%, 10/08/12	2.65%
Gob de Suecia, 5.50%, 10/08/12	2.59%
Korea Treasury Bond, senior bond, 3.00%, 12/10/13	2.34%
Korea Treasury Bond, senior bond, 3.75%, 6/10/13	2.30%
Gob de Polonia, 4.75%, 4/25/12	2.06%
United Kingdom Treasury Note, 5.25%, 6/07/12	2.00%
Gob de Polonia, Strip, 1/25/13	1.78%
Korea Treasury Bond, 4.75%, 12/10/11	1.76%
OTROS 205 EMISORES	75.05%
TOTAL	100.00%