

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
DISCRECIONAL

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>					
M	BONOS	191211	NO APLICA	96	8.088%
M	BONOS	220609	NO APLICA	39	3.230%
M	BONOS	210610	NO APLICA	34	2.852%
M	BONOS	241205	NO APLICA	30	2.552%
M	BONOS	270603	NO APLICA	19	1.590%
S	UDIBONO	251204	NO APLICA	190	15.920%
S	UDIBONO	220609	NO APLICA	146	12.225%
S	UDIBONO	190613	NO APLICA	98	8.254%
S	UDIBONO	201210	NO APLICA	94	7.840%
				<b>746</b>	<b>62.551%</b>
<b>TRAC TIT. REF. ACCIONES EXTR.</b>					
1ISP	SHY	*	N/A	66	5.559%
1ISP	IEI	*	N/A	36	3.001%
				<b>102</b>	<b>8.560%</b>
<b>VALORES EN REPORTE</b>					
LD	BONDESD	210915	NO APLICA	345	28.889%
				<b>345</b>	<b>28.889%</b>
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>1,193</b>	<b>100.000%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>1,192</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>				<b>7</b>	<b>0.60%</b>
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>				<b>2</b>	<b>0.17%</b>
<b>Cartera al:</b>			<b>29-jun-18</b>		

Metodo Historico, 1 dia con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.