

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
DISCRECIONAL

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
VALORES GUBERNAMENTALES					
M	BONOS	191211	NO APLICA	97	7.939%
M	BONOS	241205	NO APLICA	58	4.721%
M	BONOS	210610	NO APLICA	34	2.827%
M	BONOS	270603	NO APLICA	10	0.827%
BI	CETES	180301	NO APLICA	50	4.103%
BI	CETES	180328	NO APLICA	50	4.080%
S	UDIBONO	251204	NO APLICA	193	15.799%
S	UDIBONO	220609	NO APLICA	146	11.982%
S	UDIBONO	201210	NO APLICA	93	7.670%
				731	59.947%
TRAC TIT. REF. ACCIONES EXTR.					
1ISP	SHY	*	N/A	63	5.159%
1ISP	IEI	*	N/A	34	2.784%
				97	7.943%
VALORES EN REPORTO					
LD	BONDES	200702	NO APLICA	391	32.110%
				391	32.110%
TOTAL CARTERA				1,219	100.000%
ACTIVO NETO				1,169	
VAR ESTABLECIDO \$				7	0.60%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				2	0.17%
Cartera al:			28-feb-18		
Metodo Historico, 1 dia con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.					