

## SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

## CORTO PLAZO

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>					
91	NRF	18	mxAAA	302	1.037%
BI	CETES	180830	NO APLICA	26,037	89.425%
BI	CETES	181220	NO APLICA	982	3.374%
				<b>27,321</b>	<b>93.836%</b>
<b>CERTIFICADOS BURSATILES</b>					
95	PEMEX	13	BBB+	1,003	3.442%
				<b>1,003</b>	<b>3.442%</b>
<b>VALORES EN REPORTO</b>					
LD	BONDESD	210520	NO APLICA	634	2.178%
IS	BPA182	191010	NO APLICA	158	0.544%
				<b>792</b>	<b>2.722%</b>
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>29,116</b>	<b>100.000%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>29,103</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>17</b>	<b>0.06%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>4</b>	<b>0.02%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>29-jun-18</b>		

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