

SUR1

AAA/2 MO

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
VALORES GUBERNAMENTALES					
LD	BONDES	200130	NO APLICA	9,998	30.330%
LD	BONDES	200402	NO APLICA	1,004	3.047%
BI	CETES	190523	NO APLICA	6,871	20.845%
				17,873	54.222%
CERTIFICADOS BURSATILES					
91	NRF	18	mxAAA	301	0.914%
91	BBVALMX	18	AAA(mex)	46	0.135%
95	FEFA	18-4	mxAAA	502	1.523%
				849	2.572%
VALORES EN REPORTO					
LD	BONDES	200702	NO APLICA	11,379	34.518%
IQ	BPAG91	210826	NO APLICA	2,864	8.689%
				14,243	43.206%
TOTAL CARTERA				32,965	100.000%
ACTIVO NETO				32,802	
VAR ESTABLECIDO \$				20	0.06%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				1	0.00%
Cartera al:			28-feb-19		

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