

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BONDES D			1,001	3.361%
LD	BONDESD	200402	NO APLICA	1,001	3.361%
	Cedes			1,005	3.374%
F	BSCTIA	18025	mxA-1+	503	1.689%
F	BANSAN	17040	F1+(mex)	502	1.686%
	Certificado Bursatil			345	1.158%
91	NRF	18	mxAAA	300	1.009%
91	BBVALMX	18	AAA(mex)	44	0.149%
	Cetes			20,900	70.173%
BI	CETES	181025	NO APLICA	19,898	66.809%
BI	CETES	181220	NO APLICA	1,002	3.365%
	Udibonos	UDIS		4,560	15.311%
S	UDIBONO	190613	NO APLICA	4,560	15.311%
	Valores paraestatales Rendim.			1,004	3.370%
95	PEMEX	13	BBB+	1,004	3.370%
	Reportos			969	3.253%
LD	BONDESD	200702	NO APLICA	748	2.513%
IQ	BPAG91	221229	NO APLICA	221	0.741%
	TOTAL CARTERA			29,783	100.000%
	ACTIVO NETO			29,695	
	VAR ESTABLECIDO \$			18	0.060%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			10	0.034%
	Cartera al:		28-sep-18		

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