

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

MEDIANO PLAZO

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
VALORES GUBERNAMENTALES					
LD	BONDES	190606	NO APLICA	3,001	18.143%
S	UDIBONO	190613	NO APLICA	2,134	12.901%
				5,135	31.044%
VALORES PRIVADOS					
91	VWLEASE	17	A3	5,018	30.336%
91	HOLCIM	15	mxAAA	5,005	30.255%
91	NAVISC	15	mxAAA	51	0.313%
91	BBVALMX	18	AAA(mex)	27	0.162%
95	PEMEX	13	BBB+	502	3.034%
F	BSCTIA	18025	mxA-1+	604	3.649%
				11,207	67.749%
Reportos					
LD	BONDES	200730	NO APLICA	100	0.606%
S	UDIBONO	201210	NO APLICA	99	0.600%
				199	1.207%
TOTAL CARTERA				16,541	100.000%
ACTIVO NETO				16,501	
VAR ESTABLECIDO \$				58	0.350%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				4	0.027%
Cartera al:			28-sep-18		

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