

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	BONDESD	190627	NO APLICA	16,552	94.119%
				16,552	94.119%
VALORES PRIVADOS					
91	NRF	18	mxAAA	291	1.654%
91	NAVISCB	15	mxAAA	100	0.567%
F	BINTER	18004	A-1	200	1.138%
				591	3.359%
Reportos					
LD	BONDESD	200702	NO APLICA	222	1.263%
S	UDIBONO	201210	NO APLICA	221	1.259%
				443	2.522%
	TOTAL CARTERA			17,586	100.000%
	ACTIVO NETO			17,539	
	VAR ESTABLECIDO \$			61	0.350%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			1	0.006%
	Cartera al:		28-feb-18		

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