

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

(Cifras en miles de pesos)

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF / BURS | VALOR TOTAL | % |
|--|---------|--------|------------------|------------------|-----------------|
| VALORES GUBERNAMENTALES | | | | | |
| BI | CETES | 190314 | NO APLICA | 929,561 | 19.162% |
| BI | CETES | 181004 | NO APLICA | 499,670 | 10.300% |
| BI | CETES | 181011 | NO APLICA | 498,923 | 10.285% |
| BI | CETES | 190214 | NO APLICA | 352,888 | 7.274% |
| BI | CETES | 181220 | NO APLICA | 216,951 | 4.472% |
| BI | CETES | 190103 | NO APLICA | 68,586 | 1.414% |
| BI | CETES | 190131 | NO APLICA | 68,178 | 1.405% |
| LD | BONDES | 181213 | NO APLICA | 501,133 | 10.330% |
| LD | BONDES | 190808 | NO APLICA | 200,942 | 4.142% |
| LD | BONDES | 190328 | NO APLICA | 151,254 | 3.118% |
| LD | BONDES | 181011 | NO APLICA | 100,389 | 2.069% |
| LD | BONDES | 190207 | NO APLICA | 100,215 | 2.066% |
| LD | BONDES | 190411 | NO APLICA | 100,048 | 2.062% |
| LD | BONDES | 190606 | NO APLICA | 100,036 | 2.062% |
| LD | BONDES | 200402 | NO APLICA | 59,055 | 1.217% |
| LD | BONDES | 190627 | NO APLICA | 50,091 | 1.033% |
| S | UDIBONO | 190613 | NO APLICA | 731,438 | 15.078% |
| | | | | 4,729,358 | 97.489% |
| Reportos | | | | | |
| LD | BONDES | 200730 | NO APLICA | 121,832 | 2.511% |
| | | | | 121,832 | 2.511% |
| TOTAL CARTERA | | | | 4,851,190 | 100.000% |
| ACTIVO NETO | | | | 4,846,962 | |
| VAR ESTABLECIDO \$ | | | | 2,908 | 0.060% |
| VAR OBSERVADO PROMEDIO \$ | | | | 1,690 | 0.035% |
| Cartera al: | | | 28-sep-18 | | |
| Metodo Historico, 1 dia con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones. | | | | | |