

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	180301	NO APLICA	2,180,000	34.347%
BI	CETES	180405	NO APLICA	992,757	15.641%
BI	CETES	180308	NO APLICA	499,275	7.866%
BI	CETES	180412	NO APLICA	495,657	7.809%
BI	CETES	180328	NO APLICA	178,998	2.820%
BI	CETES	180426	NO APLICA	533	0.008%
LD	BONDESD	181213	NO APLICA	501,948	7.908%
LD	BONDESD	180705	NO APLICA	250,678	3.950%
LD	BONDESD	180405	NO APLICA	200,867	3.165%
LD	BONDESD	180628	NO APLICA	200,837	3.164%
LD	BONDESD	180614	NO APLICA	200,259	3.155%
LD	BONDESD	181011	NO APLICA	100,543	1.584%
LD	BONDESD	190207	NO APLICA	100,372	1.581%
LD	BONDESD	190328	NO APLICA	99,919	1.574%
				6,002,643	94.574%
Reportos					
LD	BONDESD	200702	NO APLICA	344,392	5.426%
				344,392	5.426%
TOTAL CARTERA				6,347,035	100.000%
ACTIVO NETO				4,077,269	
VAR ESTABLECIDO \$				2,446	0.060%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				175	0.004%
Cartera al:			28-feb-18		

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