

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	180705	NO APLICA	1,099,279	22.782%
BI	CETES	180920	NO APLICA	846,671	17.547%
BI	CETES	180816	NO APLICA	495,197	10.263%
BI	CETES	181220	NO APLICA	212,691	4.408%
BI	CETES	180913	NO APLICA	98,460	2.041%
BI	CETES	180712	NO APLICA	303	0.006%
LD	BONDESD	181213	NO APLICA	500,323	10.369%
LD	BONDESD	180705	NO APLICA	251,330	5.209%
LD	BONDESD	190808	NO APLICA	200,593	4.157%
LD	BONDESD	181011	NO APLICA	100,224	2.077%
LD	BONDESD	190328	NO APLICA	100,177	2.076%
LD	BONDESD	190207	NO APLICA	100,040	2.073%
S	UDIBONO	190613	NO APLICA	266,770	5.529%
				4,272,058	88.537%
Reportos					
LD	BONDESD	210915	NO APLICA	553,102	11.463%
				553,102	11.463%
TOTAL CARTERA				4,825,160	100.000%
ACTIVO NETO				4,820,988	
VAR ESTABLECIDO \$				2,893	0.060%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				653	0.013%
Cartera al:			29-jun-18		

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