

## SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

## CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>					
BI	CETES	180927	NO APLICA	294,383	20.128%
BI	CETES	180906	NO APLICA	39,434	2.696%
LD	BONDESD	181011	NO APLICA	100,224	6.853%
LD	BONDESD	181213	NO APLICA	100,065	6.842%
LD	BONDESD	180927	NO APLICA	80,417	5.499%
LD	BONDESD	190808	NO APLICA	50,149	3.429%
M	BONOS	181213	NO APLICA	655,851	44.844%
S	UDIBONO	190613	NO APLICA	69,389	4.744%
				<b>1,389,912</b>	<b>95.035%</b>
<b>Reportos</b>					
IQ	BPAG91	221229	NO APLICA	72,614	4.965%
				<b>72,614</b>	<b>4.965%</b>
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,462,526</b>	<b>100.000%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,464,415</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>1,464</b>	<b>0.100%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>476</b>	<b>0.033%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>29-jun-18</b>		

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