

## 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>					
LD	BONDESD	190328	NO APLICA	150,753	10.347%
LD	BONDESD	181011	NO APLICA	100,544	6.901%
LD	BONDESD	181213	NO APLICA	100,390	6.890%
LD	BONDESD	180705	NO APLICA	100,271	6.882%
LD	BONDESD	180927	NO APLICA	100,256	6.881%
LD	BONDESD	190606	NO APLICA	100,176	6.875%
LD	BONDESD	180628	NO APLICA	20,084	1.378%
M	BONOS	181213	NO APLICA	716,552	49.178%
				<b>1,389,026</b>	<b>95.332%</b>
<b>Reportos</b>					
LD	BONDESD	211118	NO APLICA	68,017	4.668%
				<b>68,017</b>	<b>4.668%</b>
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,457,043</b>	<b>100.000%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,463,891</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>1,464</b>	<b>0.100%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>592</b>	<b>0.041%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>28-feb-18</b>		

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