

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

MEDIANO PLAZO

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Cert. Bursatiles Bancarios			2,399	0.092%
94	BINTER	16U	AAA(mex)	2,399	0.092%
	Cert.Burs.Ind.Carr.Seg. UDIS			11,216	0.429%
2U	CBIC006	321125	NO APLICA	11,216	0.429%
	Certificado Bursatil			11,929	0.456%
90	PAMMCB	14U	mxAAA	11,929	0.456%
	Certificado Bursatil			26,807	1.024%
91	TENIXCB	14U	AA+(mex)	12,385	0.473%
91	DOIXCB	15U	mxAA+	10,871	0.415%
91	RCO	12U	mxAAA	3,552	0.136%
	Udibonos	UDIS		2,356,995	90.071%
S	UDIBONO	220609	NO APLICA	1,555,943	59.459%
S	UDIBONO	190613	NO APLICA	700,483	26.769%
S	UDIBONO	251204	NO APLICA	100,570	3.843%
	Valores paraestatales Rendim.			159,901	6.111%
95	CFE	14	Baa1	60,680	2.319%
95	PEMEX	10U	BBB+	56,323	2.152%
95	FOVISC	18U	A3	19,282	0.737%
95	PEMEX	09U	BBB+	14,329	0.548%
95	CDVITOT	14U	A3	5,552	0.212%
95	CEDEVIS	06-2U	A3	3,304	0.126%
95	CFECB	09U	Baa1	431	0.016%
	Reportos			47,568	1.818%
IQ	BPAG91	221229	NO APLICA	41,718	1.594%
IS	BPA182	250306	NO APLICA	5,850	0.224%
	TOTAL CARTERA			2,616,814	100.000%
	ACTIVO NETO			2,616,263	
	VAR ESTABLECIDO \$			46,831	1.790%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			6,549	0.250%
	Cartera al:			28-sep-18	

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