

## SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

## MEDIANO PLAZO

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>					
LD	BONDESD	180927	NO APLICA	87,454	3.358%
S	UDIBONO	220609	NO APLICA	1,369,196	52.575%
S	UDIBONO	190613	NO APLICA	740,647	28.440%
				<b>2,197,297</b>	<b>84.373%</b>
<b>CERTIFICADOS BURSATILES</b>					
94	BINTER	16U	A+(mex)	2,190	0.084%
2U	CBIC006	321125	NO APLICA	10,983	0.422%
90	PAMMCB	14U	mxAAA	11,779	0.452%
91	SOFINBU	15	mxAAA	22,493	0.864%
91	TENIXCB	14U	AA+(mex)	11,971	0.460%
91	DOIXCB	15U	mxAA+	10,476	0.402%
91	RCO	12U	mxAAA	3,518	0.135%
95	CFE	14	Baa1	60,586	2.326%
95	PEMEX	10U	BBB+	56,171	2.157%
95	FOVISCB	18U	Aaa.mx	19,441	0.747%
95	PEMEX	09U	BBB+	13,917	0.534%
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	5,769	0.222%
95	CEDEVIS	06-2U	A3	3,220	0.124%
95	CFECB	09U	Baa1	645	0.025%
				<b>233,159</b>	<b>8.953%</b>
<b>VALORES EN REPORTO</b>					
IS	BPA182	191010	NO APLICA	173,795	6.674%
				<b>173,795</b>	<b>6.674%</b>
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>2,604,251</b>	<b>100.000%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>2,599,191</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>				<b>46,526</b>	<b>1.79%</b>
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>				<b>7,499</b>	<b>0.29%</b>
<b>Cartera al:</b>			<b>29-jun-18</b>		
<b>Metodo Historico, 1 dia con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.</b>					