

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

MEDIANO PLAZO

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
VALORES GUBERNAMENTALES					
LD	BONDESD	180927	NO APLICA	100,256	3.440%
S	UDIBONO	220609	NO APLICA	1,480,735	50.802%
S	UDIBONO	190613	NO APLICA	881,361	30.238%
				2,462,352	84.480%
CERTIFICADOS BURSATILES					
F	BINTER	18004	A-1	25,011	0.858%
94	BINTER	16U	A+(mex)	2,217	0.076%
2U	CBIC006	321125	NO APLICA	10,995	0.377%
90	PAMMCB	14U	mxAAA	12,034	0.413%
91	CFCREDI	15	mxAAA	22,577	0.775%
91	TENIXCB	14U	AA+(mex)	12,811	0.440%
91	DOIXCB	15U	mxAA	10,882	0.373%
91	RCO	12U	mxAAA	3,462	0.119%
95	CFE	13	AAA(mex)	121,904	4.182%
95	PEMEX	10U	BBB+	54,052	1.854%
95	PEMEX	09U	BBB+	13,601	0.467%
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	5,691	0.195%
95	CEDEVIS	06-2U	A3	4,076	0.140%
95	CFECB	09U	Baa1	636	0.022%
				299,949	10.291%
VALORES EN REPORTO					
M	BONOS	220609	NO APLICA	152,400	5.229%
				152,400	5.229%
TOTAL CARTERA				2,914,701	100.000%
ACTIVO NETO				2,902,795	
VAR ESTABLECIDO \$				51,960	1.79%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				9,758	0.33%
Cartera al:			28-feb-18		

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