

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BONDES D			1,003,263	3.336%
LD	BONDESD	200402	NO APLICA	1,003,263	3.336%
	Cedes			501,063	1.666%
F	BSCTIA	18025	mxA-1+	501,063	1.666%
	Certificado Bursatil			345,809	1.150%
91	NRF	18	mxAAA	301,263	1.002%
91	BBVALMX	18	AAA(mex)	44,545	0.148%
	Cetes			20,823,325	69.232%
BI	CETES	181025	NO APLICA	19,825,048	65.913%
BI	CETES	181220	NO APLICA	998,277	3.319%
	Udibonos	UDIS		4,545,352	15.112%
S	UDIBONO	190613	NO APLICA	4,545,352	15.112%
	Valores paraestatales Rendim.			999,642	3.324%
95	PEMEX	13	BBB+	999,642	3.324%
	Reportos			1,859,350	6.182%
M	BONOS	270603	NO APLICA	1,487,475	4.945%
BI	CETES	190314	NO APLICA	371,875	1.236%
	TOTAL CARTERA			30,077,803	100.000%
	ACTIVO NETO			30,013,663	
	VAR ESTABLECIDO \$			18,008	0.060%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			8,349	0.028%
	Cartera al:		13-sep-18		

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