

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

MEDIANO PLAZO

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BONDES D			16,009,017	52.199%
LD	BONDESD	200402	NO APLICA	9,788,515	31.917%
LD	BONDESD	191226	NO APLICA	3,207,312	10.458%
LD	BONDESD	190606	NO APLICA	3,013,191	9.825%
	Cedes			602,220	1.964%
F	BSCTIA	18025	mxA-1+	602,220	1.964%
	Certificado Bursatil			10,104,740	32.948%
91	HOLCIM	15	mxAAA	5,025,833	16.387%
91	VWLEASE	17	A3	5,005,938	16.323%
91	NAVISCB	15	mxAAA	46,138	0.150%
91	BBVALMX	18	AAA(mex)	26,832	0.087%
	Udibonos	UDIS		2,142,440	6.986%
S	UDIBONO	190613	NO APLICA	2,142,440	6.986%
	Valores paraestatales Rendim.			500,634	1.632%
95	PEMEX	13	BBB+	500,634	1.632%
	Reportos			1,309,859	4.271%
LD	BONDESD	200702	NO APLICA	654,974	2.136%
S	UDIBONO	201210	NO APLICA	654,885	2.135%
	TOTAL CARTERA			30,668,911	100.000%
	ACTIVO NETO			30,616,459	
	VAR ESTABLECIDO \$			107,158	0.350%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			4,721	0.021%
	Cartera al:		18-oct-18		

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