

SURCETE

AAAf/S1

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BONDES D			1,002,550,657	20.349%
LD	BONDES D	181213	NO APLICA	501,505,895	10.179%
LD	BONDES D	190808	NO APLICA	199,876,322	4.057%
LD	BONDES D	181011	NO APLICA	100,466,129	2.039%
LD	BONDES D	190328	NO APLICA	100,421,368	2.038%
LD	BONDES D	190207	NO APLICA	100,280,943	2.035%
	Cetes			2,705,955,888	54.925%
BI	CETES	180920	NO APLICA	848,806,153	17.229%
BI	CETES	180816	NO APLICA	496,388,000	10.076%
BI	CETES	181004	NO APLICA	491,104,900	9.968%
BI	CETES	181011	NO APLICA	490,369,150	9.953%
BI	CETES	181220	NO APLICA	213,192,037	4.327%
BI	CETES	180913	NO APLICA	98,706,095	2.004%
BI	CETES	190103	NO APLICA	67,389,553	1.368%
	Udibonos	UDIS		618,520,018	12.555%
S	UDIBONO	190613	NO APLICA	618,520,018	12.555%
	Reportos			599,638,529	12.171%
LD	BONDES D	190606	NO APLICA	599,638,529	12.171%
	TOTAL CARTERA			4,926,665,092	100.000%
	ACTIVO NETO			4,824,287,325	
	VAR ESTABLECIDO \$			2,894,572	0.060%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			1,418,077	0.029%
	Cartera al:		12-jul-18		

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