

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BONDES D			1,652,742,112	40.113%
LD	BONDES D	181213	NO APLICA	500,599,600	12.150%
LD	BONDES D	180705	NO APLICA	250,002,843	6.068%
LD	BONDES D	180614	NO APLICA	200,895,420	4.876%
LD	BONDES D	180405	NO APLICA	200,328,434	4.862%
LD	BONDES D	180628	NO APLICA	200,298,088	4.861%
LD	BONDES D	181011	NO APLICA	100,278,335	2.434%
LD	BONDES D	190328	NO APLICA	100,237,237	2.433%
LD	BONDES D	190207	NO APLICA	100,102,155	2.430%
	Cetes			2,270,212,582	55.099%
BI	CETES	180405	NO APLICA	995,872,700	24.170%
BI	CETES	180328	NO APLICA	678,313,872	16.463%
BI	CETES	180412	NO APLICA	497,218,050	12.068%
BI	CETES	180607	NO APLICA	98,273,500	2.385%
BI	CETES	180426	NO APLICA	534,460	0.013%
	Reportos			197,255,278	4.788%
M	BONOS	200611	NO APLICA	197,255,278	4.788%
	TOTAL CARTERA			4,120,209,971	100.000%
	ACTIVO NETO			4,118,608,954	
	VAR ESTABLECIDO \$			2,471,165	0.060%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			248,873	0.006%
	Cartera al:		15/Mzo/2018		

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