

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO

(Cifras en miles de pesos)

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF / BURS | VALOR TOTAL | % |
|----------------------------------|---------|--------|------------------|---------------|-----------------|
| VALORES GUBERNAMENTALES | | | | | |
| LD | BONDES | 200130 | NO APLICA | 10,039 | 27.042% |
| LD | BONDES | 200402 | NO APLICA | 1,002 | 2.700% |
| BI | CETES | 191114 | NO APLICA | 9,844 | 26.516% |
| BI | CETES | 191107 | NO APLICA | 4,929 | 13.278% |
| BI | CETES | 191121 | NO APLICA | 4,915 | 13.239% |
| BI | CETES | 190912 | NO APLICA | 2,993 | 8.063% |
| BI | CETES | 191219 | NO APLICA | 1,466 | 3.948% |
| | | | | 35,188 | 94.786% |
| CERTIFICADOS BURSATILES | | | | | |
| 91 | NRF | 18 | A3 | 300 | 0.809% |
| 91 | BBVALMX | 18 | AAA (mex) | 44 | 0.120% |
| 95 | FEFA | 18-4 | AAA (mex) | 501 | 1.349% |
| | | | | 845 | 2.278% |
| VALORES EN REPORTE | | | | | |
| LD | BONDES | 210722 | NO APLICA | 862 | 2.322% |
| IQ | BPAG91 | 211223 | NO APLICA | 228 | 0.614% |
| | | | | 1,090 | 2.936% |
| TOTAL CARTERA | | | | 37,124 | 100.000% |
| ACTIVO NETO | | | | 37,022 | |
| VAR ESTABLECIDO \$ | | | | 22 | 0.060% |
| VAR OBSERVADO PROMEDIO \$ | | | | 1 | 0.004% |
| Cartera al: | | | 30-ago-19 | | |

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