

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
VALORES GUBERNAMENTALES					
BI	CETES	200618	NO APLICA	328,302	13.223%
BI	CETES	200423	NO APLICA	192,523	7.754%
BI	CETES	200604	NO APLICA	174,958	7.047%
BI	CETES	200813	NO APLICA	102,685	4.136%
BI	CETES	200402	NO APLICA	68,903	2.775%
M	BONOS	200611	NO APLICA	1,337,415	53.867%
M	BONOS	210610	NO APLICA	110,791	4.462%
				2,315,577	93.264%
Reportos					
LD	BONDESD	210915	NO APLICA	167,237	6.736%
				167,237	6.736%
	TOTAL CARTERA			2,482,814	100.000%
	ACTIVO NETO			2,338,576	
	VAR ESTABLECIDO \$			2,339	0.100%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			920	0.041%
	Cartera al:		30-ago-19		

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