

## SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

## MEDIANO PLAZO

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>					
LD	BONDESD	191205	NO APLICA	67,426	2.561%
S	UDIBONO	220609	NO APLICA	1,333,509	50.659%
S	UDIBONO	201210	NO APLICA	507,466	19.278%
S	UDIBONO	251204	NO APLICA	133,977	5.090%
S	UDIBONO	351122	NO APLICA	20,529	0.780%
BI	CETES	191107	NO APLICA	78,867	2.996%
BI	CETES	191114	NO APLICA	24,610	0.935%
				<b>2,166,384</b>	<b>82.299%</b>
<b>CERTIFICADOS BURSATILES</b>					
F	BSCTIA	19016	mxA-1+	50,212	1.908%
F	BANORTE	19015	MX-1	50,202	1.907%
94	BACOMER	10U	Aaa.mx	49,311	1.873%
94	HSBC	19	Aaa.mx	20,168	0.766%
94	BINTER	16U	HR AAA	2,647	0.101%
2U	CBIC006	321125	NO APLICA	11,952	0.454%
90	PAMMCB	14U	HR AAA	12,355	0.469%
91	TENIXCB	14U	AA+ (mex)	11,235	0.427%
91	DOIXCB	15U	HR AA+	10,028	0.381%
91	RCO	12U	mxAAA	419	0.016%
95	CFE	14	Aa1.mx	60,660	2.304%
95	PEMEX	10U	mxAAA	57,385	2.180%
95	FOVISCB	18U	A3	18,422	0.700%
95	PEMEX	09U	BBB+	15,435	0.586%
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	4,866	0.185%
				<b>375,297</b>	<b>14.257%</b>
<b>VALORES EN REPORTO</b>					
IQ	BPAG91	211223	NO APLICA	90,661	3.444%
				<b>90,661</b>	<b>3.444%</b>
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>2,632,342</b>	<b>100.000%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>2,658,243</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>				<b>47,583</b>	<b>1.790%</b>
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>				<b>2,890</b>	<b>0.112%</b>
<b>Cartera al:</b>			<b>30-ago-19</b>		
<b>Metodo Historico, 1 dia con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.</b>					