

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	190214	NO APLICA	855,141	16.088%
BI	CETES	190110	NO APLICA	698,732	13.146%
BI	CETES	190103	NO APLICA	659,849	12.414%
BI	CETES	190228	NO APLICA	509,936	9.594%
BI	CETES	190207	NO APLICA	406,713	7.652%
BI	CETES	190131	NO APLICA	69,548	1.308%
BI	CETES	190117	NO APLICA	10,009	0.188%
LD	BONDESD	191024	NO APLICA	400,933	7.543%
LD	BONDESD	191205	NO APLICA	201,063	3.783%
LD	BONDESD	200130	NO APLICA	201,033	3.782%
LD	BONDESD	190808	NO APLICA	200,184	3.766%
LD	BONDESD	190328	NO APLICA	151,622	2.853%
LD	BONDESD	190801	NO APLICA	130,333	2.452%
LD	BONDESD	190207	NO APLICA	100,452	1.890%
LD	BONDESD	190411	NO APLICA	100,281	1.887%
LD	BONDESD	190606	NO APLICA	100,268	1.886%
LD	BONDESD	200402	NO APLICA	59,189	1.114%
LD	BONDESD	190627	NO APLICA	50,210	0.945%
LD	BONDESD	200528	NO APLICA	20,018	0.377%
				4,925,514	92.668%
Reportos					
LD	BONDESD	200730	NO APLICA	389,726	7.332%
				389,726	7.332%
TOTAL CARTERA				5,315,240	100.000%
ACTIVO NETO				4,670,243	
VAR ESTABLECIDO \$				2,802	0.060%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				159	0.003%
Cartera al:			31-dic-18		
Metodo Historico, 1 dia con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.					