

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	BONDES D			1,654,010,576	39.218%
LD	BONDES D	181213	NO APLICA	501,340,660	11.887%
LD	BONDES D	180705	NO APLICA	250,372,878	5.937%
LD	BONDES D	180405	NO APLICA	200,624,820	4.757%
LD	BONDES D	180628	NO APLICA	200,594,606	4.756%
LD	BONDES D	180614	NO APLICA	200,014,276	4.743%
LD	BONDES D	181011	NO APLICA	100,426,741	2.381%
LD	BONDES D	190328	NO APLICA	100,386,507	2.380%
LD	BONDES D	190207	NO APLICA	100,250,088	2.377%
	Cetes			2,273,551,666	53.908%
BI	CETES	180405	NO APLICA	997,346,100	23.648%
BI	CETES	180328	NO APLICA	679,292,052	16.107%
BI	CETES	180412	NO APLICA	497,966,100	11.807%
BI	CETES	180607	NO APLICA	98,412,160	2.333%
BI	CETES	180426	NO APLICA	535,254	0.013%
	Reportos			289,874,089	6.873%
LD	BONDES D	200702	NO APLICA	289,874,089	6.873%
	TOTAL CARTERA			4,217,436,331	100.000%
	ACTIVO NETO			4,214,973,871	
	VAR ESTABLECIDO \$			2,528,984	0.060%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			229,961	0.006%
	Cartera al:		22/Mzo/2018		

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