

ING-1

AAA/3 F

**SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS
DE DEUDA
DE CORTO PLAZO, EN FUNCION DE LA DURACION DE LOS ACTIVOS OBJETO DE
INVERSION, ESTIPULADOS EN SU ESTRATEGIA**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	CERTIFICADOS BURSATILES			12,994,032	3.94%
90	GDFCB	07-2	mxAAA	7,844,900	2.38%
90	CBPF	48	Aaa.mx	3,061,559	0.93%
90	GDFCB	10	mxAAA	2,087,573	0.63%
	CERTIFICADOS BURSATILES			46,902,868	14.24%
91	TELMEX	07-2	mxAAA	6,008,114	1.82%
91	ARCA	09-4	mxAAA	5,098,365	1.55%
91	BNPPPF	09-2	mxAAA	5,008,411	1.52%
91	CATFIN	11	mxAAA	5,011,669	1.52%
91	GASN	11-2	mxAA+	4,496,537	1.37%
91	KIMBER	09-3	mxAAA	3,062,113	0.93%
91	NRF	10-2	mxAAA	3,027,081	0.92%
91	VWLEASE	11	mxAAA	3,011,997	0.91%
91	HSCCB	06	mxBB+	2,412,178	0.73%
91	VWLEASE	10	mxAAA	2,013,362	0.61%
91	NRF	10	mxAAA	2,018,953	0.61%
91	CICB	08	mxCCC	1,834,352	0.56%
91	BCI	11	mxAAA	1,801,802	0.55%
91	VWLEASE	07	mxAAA	1,000,328	0.30%
91	DAIMLER	11	mxAAA	1,002,129	0.30%
91	METROCB	03-3	mxCCC	95,477	0.03%
	CERT. BURSATILES BANCARIOS			5,196,979	1.58%
94	BACOMER	11-2	Aaa.mx	3,005,796	0.91%
94	NAFIN	10	AAA(mex)	2,191,183	0.67%
	VALORES PARAESTATALES RENDIM			10,333,508	3.14%
95	CFEGCB	12	Aaa.mx	5,009,750	1.52%
95	PEMEX	10-3	mxAAA	3,020,428	0.92%
95	CFECB	05	mxAAA	2,303,330	0.70%
	CETES CERTIFICADOS DE LA TESOR			17,533,985	5.32%
BI	CETES	120823	mxA-1+	11,702,749	3.55%
BI	CETES	120920	mxA-1+	5,831,236	1.77%
	EUROBONOS A MEDIANO PLAZO MXP			6,980,144	2.12%
D8	KEXIM	1-08	A	6,980,144	2.12%
	Tit. Deuda de Org. Multilat.			3,105,137	0.94%
J1	CII	1-11		3,105,137	0.94%
	REPORTOS			226,436,759	68.73%
LD	BONDESD	160303	mxAAA	226,436,759	68.73%
	TOTAL CARTERA			329,483,411	100.00%
	ACTIVO NETO			329,216,801	
	VAR ESTABLECIDO \$			197,530	0.06%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			3,284	0.00%
	Cartera al:		2/Feb/2012		

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