

**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			18,490,080	8.77%
90	GDFCB	07-2	mxAAA	9,867,200	4.68%
90	CBPF	48	Aaa.mx	8,622,880	4.09%
	CERTIFICADOS BURSATILES			49,099,887	23.29%
91	HSCCB	06	mxA+	17,141,552	8.13%
91	CICB	08	mxAA-	7,410,776	3.52%
91	PACCAR	08	mxAAA	5,970,217	2.83%
91	GMACHIP	07	mxBB+	4,651,563	2.21%
91	GMACFIN	07	mxBB+	4,557,681	2.16%
91	TELFIM	10-2	mxAAA	4,013,524	1.90%
91	METROCB	04	mxCCC	1,789,199	0.85%
91	HSCCB	06-2	mxD	1,306,868	0.62%
91	VWLEASE	07	mxAAA	988,804	0.47%
91	HSCCB	04-2	mxCCC	604,370	0.29%
91	METROCB	03-2	mxCCC	348,535	0.17%
91	METROCB	03-3	mxCCC	256,502	0.12%
91	METROCB	02	mxCCC	60,296	0.03%
	CERTIFICADOS BURSATILES			3,995,866	1.90%
93	GEGB	04610	mxA-1+	3,995,866	1.90%
	CERT. BURSATILES BANCARIOS			4,980,825	2.36%
94	HSBC	06	mxAAA	4,980,825	2.36%
	VALORES PARAESTATALES RENDIM.			5,020,097	2.38%
95	CFECB	03	mxAAA	5,020,097	2.38%
	CETES CERTIFICADOS DE LA TESOR			39,540,618	18.76%
BI	CETES	101202	mxAAA	19,765,616	9.38%
BI	CETES	101014	mxAAA	9,945,474	4.72%
BI	CETES	110113	mxAAA	9,829,528	4.66%
	EUROBONOS A MEDIANO PLAZO MXP			43,979,970	20.86%
D8	SANTAN	2-07	AA-	23,139,008	10.98%
D8	KEXIM	1-08	A	19,842,535	9.41%
D8	CARGILL	1-08	A	998,427	0.47%
	UDIBONOS	UDIS		159,983	0.08%
S	UDIBONO	120621	mxAAA	124,070	0.06%
S	UDIBONO	171214	mxAAA	35,913	0.02%
	REPORTOS			45,540,206	21.60%
LD	BONDESD	131121	mxAAA	45,540,206	21.60%
	TOTAL CARTERA			210,807,533	100.00%
	ACTIVO NETO			210,588,148	
	VAR ESTABLECIDO \$			126,353	0.06%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			6,260	0.00%
	Cartera al:		31/Ago/2010		

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