

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	%
VALORES GUBERNAMENTALES					
90	CBPF	48	Aaa.mx	8,672	1.902%
90	GDFCB	07-2	mxAAA	7,868	1.726%
BI	CETES	120823	mxA-1+	106,824	23.434%
BI	CETES	120920	mxA-1+	29,023	6.367%
S	UDIBONO	120621	mxAAA	127	0.028%
S	UDIBONO	171214	mxAAA	38	0.008%
				152,552	33.465%
VALORES PRIVADOS					
91	HSCCB	06	mxBB+	7,490	1.643%
91	BNPPPF	09-2	mxAAA	6,011	1.319%
91	TELMEX	07-2	mxAAA	6,002	1.317%
91	CATFIN	11	mxAAA	6,013	1.319%
91	CICB	08	mxCCC	5,151	1.130%
91	NRF	10	mxAAA	5,042	1.106%
91	BCI	11	mxAAA	5,002	1.097%
91	NRF	11	mxAAA	5,036	1.105%
91	GASN	11-2	mxAA+	4,993	1.095%
91	GMACHIP	07	mxCCC	4,185	0.918%
91	TELFIM	10-2	mxAAA	4,027	0.883%
91	VWLEASE	11	mxAAA	4,014	0.881%
91	METROCB	04	mxCCC	1,488	0.326%
91	VWLEASE	07	mxAAA	1,000	0.219%
91	HSCCB	06-2	mxD	600	0.132%
91	METROCB	03-2	mxCCC	340	0.075%
91	METROCB	03-3	mxCCC	239	0.052%
94	BACOMER	11-2	Aaa.mx	3,004	0.659%
95	CFE	10	Aaa.mx	2,001	0.439%
D8	KEXIM	1-08	A	19,934	4.373%
D8	SANTAN	2-07	A	3,887	0.853%
J1	CII	1-11		3,504	0.769%
				98,963	21.710%
REPORTOS					
LD	BONDESD	180328	mxAAA	204,330	44.825%
				204,330	44.825%
TOTAL CARTERA				455,845	100.000%
ACTIVO NETO				455,512	
VAR ESTABLECIDO \$				273	0.06%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				29	0.01%
Cartera al:			30/Dic/2011		