

ING-30

A/4 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	%
	UDIBONOS	UDIS		166,215	0.04%
S	UDIBONO	120621	mxAAA	127,703	0.03%
S	UDIBONO	171214	mxAAA	38,512	0.01%
	CERTIFICADOS BURSATILES			16,519,318	4.12%
90	CBPF	48	Aaa.mx	8,674,418	2.17%
90	GDFCB	07-2	mxAAA	7,844,900	1.96%
	CERTIFICADOS BURSATILES			64,264,168	16.04%
91	HSCCB	06	mxBB+	6,030,444	1.51%
91	BNPPPF	09-2	mxAAA	6,010,093	1.50%
91	TELMEX	07-2	mxAAA	6,008,114	1.50%
91	CATFIN	11	mxAAA	6,014,003	1.50%
91	NRF	10	mxAAA	5,047,382	1.26%
91	NRF	11	mxAAA	5,055,674	1.26%
91	GASN	11-2	mxAA+	4,996,152	1.25%
91	BCI	11	mxAAA	5,005,007	1.25%
91	CICB	08	mxCCC	4,891,605	1.22%
91	TELFIM	10-2	mxAAA	4,012,553	1.00%
91	VWLEASE	11	mxAAA	4,015,996	1.00%
91	GMACHIP	07	mxCCC	3,710,178	0.93%
91	METROCB	04	mxCCC	1,488,217	0.37%
91	VWLEASE	07	mxAAA	1,000,328	0.25%
91	HSCCB	06-2	mxD	400,000	0.10%
91	METROCB	03-2	mxCCC	339,730	0.09%
91	METROCB	03-3	mxCCC	238,692	0.06%
	CERT. BURSATILES BANCARIOS			3,005,796	0.75%
94	BACOMER	11-2	Aaa.mx	3,005,796	0.75%
	VALORES PARAESTATALES RENDIM			8,010,198	2.00%
95	CFEGCB	12	Aaa.mx	6,011,700	1.50%
95	CFE	10	Aaa.mx	1,998,498	0.50%
	CETES CERTIFICADOS DE LA TESOR			136,431,379	34.06%
BI	CETES	120823	mxA-1+	107,275,201	26.78%
BI	CETES	120920	mxA-1+	29,156,178	7.28%
	EUROBONOS A MEDIANO PLAZO MXP			23,833,577	5.95%
D8	KEXIM	1-08	A	19,943,268	4.98%
D8	SANTAN	2-07	A	3,890,309	0.97%
	Tit. Deuda de Org. Multilat.			3,505,800	0.88%
JI	CII	1-11		3,505,800	0.88%
	REPORTOS			144,828,967	36.16%
LD	BONDESD	180328	mxAAA	144,828,967	36.16%
	TOTAL CARTERA			400,565,417	100.00%
	ACTIVO NETO			400,270,835	
	VAR ESTABLECIDO \$			240,163	0.06%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			25,469	0.01%
	Cartera al:		2/Feb/2012		

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