

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	%
	CERTIFICADOS BURSATILES			18,494,568	9.18%
90	GDFCB	07-2	mxAAA	9,869,975	4.90%
90	CBPF	48	Aaa.mx	8,624,593	4.28%
	CERTIFICADOS BURSATILES			49,132,722	24.38%
91	HSCCB	06	mxA+	17,158,839	8.51%
91	CICB	08	mxAA-	7,415,174	3.68%
91	PACCAR	08	mxAAA	5,972,025	2.96%
91	GMACHIP	07	mxBB+	4,654,847	2.31%
91	GMACFIN	07	mxBB+	4,561,247	2.26%
91	TELFIM	10-2	mxAAA	4,014,672	1.99%
91	METROCB	04	mxCCC	1,789,199	0.89%
91	HSCCB	06-2	mxD	1,306,868	0.65%
91	VWLEASE	07	mxAAA	989,751	0.49%
91	HSCCB	04-2	mxCCC	604,767	0.30%
91	METROCB	03-2	mxCCC	348,535	0.17%
91	METROCB	03-3	mxCCC	256,502	0.13%
91	METROCB	02	mxCCC	60,296	0.03%
	CERTIFICADOS BURSATILES			3,996,907	1.98%
93	GECB	04610	mxA-1+	3,996,907	1.98%
	CERT. BURSATILES BANCARIOS			4,982,118	2.47%
94	HSBC	06	mxAAA	4,982,118	2.47%
	VALORES PARAESTATALES RENDIM			5,021,651	2.49%
95	CFECB	03	mxAAA	5,021,651	2.49%
	CETES CERTIFICADOS DE LA TESOR			39,551,152	19.62%
BI	CETES	101202	mxAAA	19,771,100	9.81%
BI	CETES	101014	mxAAA	9,947,997	4.94%
BI	CETES	110113	mxAAA	9,832,055	4.88%
	EUROBONOS A MEDIANO PLAZO MXP			43,993,660	21.83%
D8	SANTAN	2-07	AA-	23,146,809	11.48%
D8	KEXIM	1-08	A	19,848,103	9.85%
D8	CARGILL	1-08	A	998,748	0.50%
	UDIBONOS	UDIS		159,902	0.08%
S	UDIBONO	120621	mxAAA	124,060	0.06%
S	UDIBONO	171214	mxAAA	35,842	0.02%
	REPORTOS			36,235,658	17.98%
LD	BONDESD	120607		36,235,658	17.98%
	TOTAL CARTERA			201,568,336	100.00%
	ACTIVO NETO			201,477,897	
	VAR ESTABLECIDO \$			120,887	0.06%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			5,411	0.00%
	Cartera al:		2/Sep/2010		

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