

INGCETE**AAA/2 F****SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS
DE DEUDA****DE CORTO PLAZO, ESPECIALIZADA EN VALORES GUBERNAMENTALES**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	CETES CERTIFICADOS DE LA TESOR			2,005,705,523	54.71%
BI	CETES	120322	mxA-1+	586,546,612	16.00%
BI	CETES	120329	mxAAA	496,646,250	13.55%
BI	CETES	120517	mxA-1+	394,936,400	10.77%
BI	CETES	120920	mxA-1+	223,530,698	6.10%
BI	CETES	121018	mxA-1+	101,694,957	2.77%
BI	CETES	120628	mxA-1+	98,224,280	2.68%
BI	CETES	120308	mxA-1+	49,796,360	1.36%
BI	CETES	120503	mxA-1+	49,453,820	1.35%
BI	CETES	120823	mxA-1+	4,876,146	0.13%
	REPORTOS			1,660,328,749	45.29%
LD	BONDESD	180628	mxAAA	1,660,328,749	45.29%
	TOTAL CARTERA			3,666,034,272	100.00%
	ACTIVO NETO			3,665,277,216	
	VAR ESTABLECIDO \$			2,199,166	0.06%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			143,871	0.00%
	Cartera al:			2/Feb/2012	

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