

SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

DE CORTO PLAZO ESPECIALIZADA EN VALORES GUBERNAMENTALES

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
VALORES GUBERNAMENTALES					
BI	CETES	120920	mxA-1+	290,233	13.346%
BI	CETES	121213	mxAAA	191,465	8.804%
BI	CETES	120823	mxA-1+	155,381	7.145%
BI	CETES	120308	mxA-1+	46,076	2.119%
BI	CETES	120503	mxA-1+	18,713	0.861%
M	BONOS	130620	mxAAA	10,616	0.488%
M	BONOS	140619	mxAAA	10,483	0.482%
M	BONOS	200611	mxAAA	3,342	0.154%
MO	BONOS	121220	mxAAA	1,310,697	60.272%
S	UDIBONO	141218	mxAAA	256	0.012%
				2,037,262	93.683%
REPORTOS					
IT	BPAT	160811	mxAAA	137,371	6.317%
				137,371	6.317%
TOTAL CARTERA				2,174,633	100.000%
ACTIVO NETO				2,178,414	
VAR ESTABLECIDO \$				2,178	0.10%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				529	0.03%
Cartera al:			30/Dic/2011		

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