

**ING-GOB****AAA/4 F****SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS  
DE DEUDA****DE CORTO PLAZO, ESPECIALIZADA EN VALORES GUBERNAMENTALES**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>CETES CERTIFICADOS DE LA TESOR</b>			<b>540,442,067</b>	<b>29.24%</b>
BI	CETES	101216	mxAAA	230,905,327	12.49%
BI	CETES	110728	mxAAA	191,709,340	10.37%
BI	CETES	110210	mxAAA	68,576,655	3.71%
BI	CETES	101230	mxAAA	49,250,745	2.66%
	<b>BONOS</b>			<b>1,267,039,651</b>	<b>68.54%</b>
M	BONOS	110623	mxAAA	1,046,677,500	56.62%
M	BONOS	101223	mxAAA	167,196,433	9.05%
M	BONOS	120621	mxAAA	53,165,718	2.88%
	<b>BONOS 10 AÑOS</b>			<b>330,087</b>	<b>0.02%</b>
M0	BONOS	121220	mxAAA	330,087	0.02%
	<b>REPORTOS</b>			<b>40,767,168</b>	<b>2.21%</b>
IS	BPA182	160331		40,767,168	2.21%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,848,578,973</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,848,406,781</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>1,848,407</b>	<b>0.10%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>398,067</b>	<b>0.02%</b>
	<b>Cartera al:</b>			<b>2/Sep/2010</b>	

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