

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	%
	UDIBONOS	UDIS		261,363	0.01%
S	UDIBONO	141218	mxAAA	261,363	0.01%
	CETES CERTIFICADOS DE LA TESOR			698,481,832	34.17%
BI	CETES	120920	mxA-1+	291,561,780	14.26%
BI	CETES	121213	mxAAA	192,324,980	9.41%
BI	CETES	120823	mxA-1+	98,498,139	4.82%
BI	CETES	121018	mxA-1+	96,852,340	4.74%
BI	CETES	120503	mxA-1+	18,792,452	0.92%
BI	CETES	120308	mxA-1+	452,141	0.02%
	BONOS			24,746,577	1.21%
M	BONOS	130620	mxAAA	10,692,389	0.52%
M	BONOS	140619	mxAAA	10,594,137	0.52%
M	BONOS	200611	mxAAA	3,460,051	0.17%
	BONOS 10 AÑOS			1,317,067,727	64.42%
M0	BONOS	121220	mxAAA	1,317,067,727	64.42%
	REPORTOS			3,802,479	0.19%
LD	BONDESD	160107	mxAAA	3,802,479	0.19%
	TOTAL CARTERA			2,044,359,978	100.00%
	ACTIVO NETO			2,043,844,177	
	VAR ESTABLECIDO \$			2,043,844	0.10%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			579,272	0.03%
	Cartera al:		2/Feb/2012		

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