

AMEX-MD**AAA/3 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			9,985,873	7.42%
90	GDFCB	07-2	mxAAA	7,063,378	5.25%
90	CBPF	48	Aaa.mx	1,530,780	1.14%
90	GDFCB	10	mxAAA	1,391,715	1.04%
	CERTIFICADOS BURSATILES			16,400,152	12.19%
91	ARCA	09-4	mxAAA	4,078,692	3.03%
91	KIMBER	09-3	mxAAA	2,041,409	1.52%
91	NRF	10-2	mxAAA	2,018,054	1.50%
91	BNPPPF	09-2	mxAAA	2,003,364	1.49%
91	CICB	08	mxCCC	1,222,901	0.91%
91	HSCCB	06	mxBB+	1,206,089	0.90%
91	VWLEASE	11	mxAAA	1,003,999	0.75%
91	VWLEASE	07	mxAAA	1,000,328	0.74%
91	DAIMLER	11	mxAAA	1,002,129	0.75%
91	GMACHIP	07	mxCCC	742,036	0.55%
91	METROCB	03-3	mxCCC	81,151	0.06%
	CERT. BURSATILES BANCARIOS			743,796	0.55%
94	NAFIN	10	AAA(mex)	743,796	0.55%
	VALORES PARAESTATALES RENDIM.			4,676,270	3.48%
95	PEMEX	10-3	mxAAA	2,013,618	1.50%
95	CFECB	05	mxAAA	1,872,339	1.39%
95	CFECB	10	Aaa.mx	790,313	0.59%
	CETES CERTIFICADOS DE LA TESOR			6,819,891	5.07%
BI	CETES	120823	mxA-1+	4,876,146	3.63%
BI	CETES	120920	mxA-1+	1,943,745	1.45%
	EUROBONOS A MEDIANO PLAZO MXP			3,988,654	2.97%
D8	KEXIM	1-08	A	3,988,654	2.97%
	Tit. Deuda de Org. Multilat.			1,001,657	0.75%
JI	CII	1-11		1,001,657	0.75%
	REPORTOS			90,890,367	67.57%
LD	BONDES	130926		90,890,367	67.57%
	TOTAL CARTERA			134,506,659	100.00%
	ACTIVO NETO			134,381,447	
	VAR ESTABLECIDO \$			80,629	0.06%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			1,229	0.00%
	Cartera al:		2/Feb/2012		

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