

ING-30

AA/4M

**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	%
	UDIBONOS	UDIS		165,947	0.04%
S	UDIBONO	120621	mxAAA	127,600	0.03%
S	UDIBONO	171214	mxAAA	38,347	0.01%
	CERTIFICADOS BURSATILES			16,510,226	3.72%
90	CBPF	48	Aaa.mx	8,665,867	1.95%
90	GDFCB	07-2	mxAAA	7,844,359	1.77%
	CERTIFICADOS BURSATILES			64,271,760	14.48%
91	BNPPPF	09-2	mxAAA	6,032,510	1.36%
91	HSCCB	06	mxBB+	6,005,000	1.35%
91	TELMEX	07-2	mxAAA	6,001,838	1.35%
91	CATFIN	11	mxAAA	6,008,025	1.35%
91	NRF	10	mxAAA	5,042,487	1.14%
91	NRF	11	mxAAA	5,050,681	1.14%
91	GASN	11-2	mxAA+	5,012,046	1.13%
91	BCI	11	mxAAA	5,020,220	1.13%
91	CICB	08	mxCCC	4,861,924	1.10%
91	TELFIM	10-2	mxAAA	4,025,116	0.91%
91	VWLEASE	11	mxAAA	4,011,997	0.90%
91	GMACHIP	07	mxCCC	3,733,931	0.84%
91	METROCB	04	mxCCC	1,488,217	0.34%
91	VWLEASE	07	mxAAA	999,346	0.23%
91	HSCCB	06-2	mxD	400,000	0.09%
91	METROCB	03-2	mxCCC	339,730	0.08%
91	METROCB	03-3	mxCCC	238,692	0.05%
	CERT. BURSATILES BANCARIOS			3,002,901	0.68%
94	BACOMER	11-2	Aaa.mx	3,002,901	0.68%
	VALORES PARAESTATALES RENDIM.			8,011,649	1.81%
95	CFEGCB	12		6,003,350	1.35%
95	CFE	10	Aaa.mx	2,008,299	0.45%
	CETES CERTIFICADOS DE LA TESOR			136,346,090	30.72%
BI	CETES	120823	mxA-1+	107,210,939	24.16%
BI	CETES	120920	mxA-1+	29,135,151	6.56%
	EUROBONOS A MEDIANO PLAZO MXP			23,895,808	5.38%
D8	KEXIM	1-08	A	20,009,886	4.51%
D8	SANTAN	2-07	A	3,885,922	0.88%
	Tit. Deuda de Org. Multilat.			3,502,518	0.79%
JI	CII	1-11		3,502,518	0.79%
	REPORTOS			188,140,343	42.39%
BI	CETES	120503	mxA-1+	188,140,343	42.39%
	TOTAL CARTERA			443,847,240	100.00%
	ACTIVO NETO			443,179,087	
	VAR ESTABLECIDO \$			265,907	0.06%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			26,379	0.01%
	Cartera al:		26/Ene/2012		

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