

ING-1

AAA/3M

**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	%
	<b>CERTIFICADOS BURSATILES</b>			<b>12,800,680</b>	<b>10.10%</b>
90	GDFCB	07-2	mxAAA	9,756,851	7.70%
90	CBPF	48	Aaa.mx	3,043,829	2.40%
	<b>CERTIFICADOS BURSATILES</b>			<b>29,910,509</b>	<b>23.60%</b>
91	HSCCB	06	mxA+	5,426,902	4.28%
91	ARCA	09-4	mxAAA	5,061,913	3.99%
91	PACCAR	08	mxAAA	3,972,233	3.13%
91	TELFIM	05	mxAAA	3,029,456	2.39%
91	KIMBER	09-3	mxAAA	3,029,705	2.39%
91	DAIMLER	09	mxAAA	3,009,773	2.37%
91	CICB	08	mxAA-	2,928,925	2.31%
91	CICB	06	mxAAA	1,373,045	1.08%
91	BNPPPF	09	mxAAA	1,016,604	0.80%
91	VWLEASE	07	mxAAA	954,094	0.75%
91	METROCB	03-3	mxCCC	107,859	0.09%
	<b>CERT. BURSATILES BANCARIOS</b>			<b>3,694,331</b>	<b>2.91%</b>
94	HSBC	06	mxAAA	3,694,331	2.91%
	<b>VALORES PARAESTATALES RENDIM</b>			<b>3,618,587</b>	<b>2.86%</b>
95	CFECB	05	mxAAA	3,618,587	2.86%
	<b>CETES CERTIFICADOS DE LA TESOR</b>			<b>11,847,076</b>	<b>9.35%</b>
BI	CETES	100506	mxAAA	5,952,383	4.70%
BI	CETES	100701	mxAAA	3,939,575	3.11%
BI	CETES	100826	mxAAA	1,955,118	1.54%
	<b>EUROBONOS MXP</b>			<b>125,114</b>	<b>0.10%</b>
D2	HSBC870	150510	BBB+	125,114	0.10%
	<b>EUROBONOS A MEDIANO PLAZO MXP</b>			<b>20,600,454</b>	<b>16.25%</b>
D8	KEXIM	1-08	A	12,884,726	10.17%
D8	SANTAN	2-07	AA-	7,715,728	6.09%
	<b>REPORTOS</b>			<b>44,162,742</b>	<b>34.84%</b>
BI	CETES	100729		44,162,742	34.84%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>126,759,494</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>126,773,629</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>76,064</b>	<b>0.06%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>2,077</b>	<b>0.00%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>4/Mar/2010</b>		

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