

INGCETE**AAA/2F****SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA****DE CORTO PLAZO, ESPECIALIZADA EN VALORES GUBERNAMENTALES**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
VALORES GUBERNAMENTALES					
BI	CETES	121018	mxA-1+	679,674	16.466%
BI	CETES	120329	mxAAA	494,633	11.983%
BI	CETES	120517	mxA-1+	393,281	9.528%
BI	CETES	120920	mxA-1+	222,512	5.391%
BI	CETES	120628	mxA-1+	97,799	2.369%
BI	CETES	120322	mxA-1+	89,111	2.159%
BI	CETES	120308	mxA-1+	49,593	1.201%
BI	CETES	120503	mxA-1+	49,246	1.193%
BI	CETES	120823	mxA-1+	4,856	0.118%
				2,080,705	50.408%
REPORTOS					
LD	BONDESD	180328	mxAAA	2,047,129	49.592%
				2,047,129	49.592%
TOTAL CARTERA				4,127,834	100.000%
ACTIVO NETO				4,029,255	
VAR ESTABLECIDO \$				2,418	0.06%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				286	0.01%
Cartera al:			30/Dic/2011		

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