

**SOCIEDAD DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>BONDES D</b>			<b>185,262,445</b>	<b>11.132%</b>
LD	BONDESD	170427	NO APLICA	185,262,445	11.132%
	<b>Bonos Gob. Fed. Tasa fija</b>			<b>897,286,805</b>	<b>53.917%</b>
M	BONOS	161215	NO APLICA	755,037,000	45.369%
M	BONOS	180614	NO APLICA	101,987,944	6.128%
M	BONOS	160616	NO APLICA	36,003,001	2.163%
M	BONOS	210610	NO APLICA	3,195,232	0.192%
M	BONOS	220609	NO APLICA	1,063,628	0.064%
	<b>Udibonos</b>	<b>UDIS</b>		<b>395,317</b>	<b>0.024%</b>
S	UDIBONO	190613	NO APLICA	395,317	0.024%
	<b>Reportos</b>			<b>581,260,129</b>	<b>34.927%</b>
LD	BONDESD	190411	NO APLICA	581,260,129	34.927%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>1,664,204,696</b>	<b>100.000%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>1,663,228,933</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>1,663,229</b>	<b>0.100%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>306,281</b>	<b>0.019%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>19-may-16</b>		

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