

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				4,001,196	400,455,003.89	6.54
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG BONDESG 270506			mxAAA	1,241,684	124,063,077.88	2.03
OTROS TIPO DE VALOR LG - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G				3,500,000	350,682,274.80	5.73
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
OTROS TIPO DE VALOR IM - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL				2,200,000	220,225,409.70	3.60
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
OTROS TIPO DE VALOR IQ - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL				1,692,000	169,224,881.76	2.77
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				7,457,168	748,122,701.61	12.23
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO				6,423,057	643,803,396.36	10.52
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				5,996,817	598,380,100.16	9.78
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				4,575,945	459,049,832.69	7.50
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL				1,400,000	140,846,208.30	2.30
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
OTROS TIPO DE VALOR F - CERTIFICADOS DE DEPÓSITO				13,050,000	1,309,355,487.20	21.40
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				21,000,000	202,627,440.00	3.31
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM SABADEL 2928101				311,542,140	312,283,731.23	5.10
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,679,119,545.58	92.81
REPORTO						
M BONOS 260305			mxAAA	2,130,129	218,340,160.62	3.57
LF BONDESF 300124			mxAAA	1,809,385	179,820,252.15	2.94
TOTAL REPORTO					398,160,412.77	6.51
OTROS VALORES						
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				421,077	42,025,343.97	0.69
100.00						

CATEGORÍA
 IDCp

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAA/1 HR	0.002%	0.040%

Valor en riesgo por simulación histórica con horizonte temporal de 1 día, con 500 observaciones al 95% de nivel de confianza.