

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	261203	mxAAA	900,000	90,037,617.30	2.12
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				7,612,527	761,398,228.88	17.90
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDES G	270218	mxAAA	1,200,000	120,163,117.20	2.83
LG	BONDES G	270506	mxAAA	1,150,000	115,255,091.85	2.71
LG	BONDES G	260716	mxAAA	1,000,000	100,059,528.00	2.35
OTROS TIPO DE VALOR LG - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G				1,300,000	130,086,370.80	3.06
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG 28	261105	mxAAA	1,400,000	140,062,847.40	3.29
IM	BPAG 28	271104	mxAAA	1,000,000	99,820,919.00	2.35
IM	BPAG 28	270805	mxAAA	940,500	94,063,440.69	2.21
OTROS TIPO DE VALOR IM - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONA				1,000,000	100,093,703.00	2.35
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG 91	270506	mxAAA	1,700,000	172,958,639.20	4.07
IQ	BPAG 91	260507	mxAAA	1,150,000	117,120,881.75	2.75
IQ	BPAG 91	270107	mxAAA	1,000,000	100,421,297.00	2.36
OTROS TIPO DE VALOR IQ - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICION				1,743,000	176,221,092.56	4.14
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260219	mxAAA	18,000,000	179,429,994.00	4.22
BI	CETES	260305	mxAAA	11,368,000	113,011,345.61	2.66
BI	CETES	260416	mxAAA	11,288,761	111,306,257.78	2.62
BI	CETES	260611	mxAAA	10,000,000	97,521,570.00	2.29
BI	CETES	270708	mxAAA	10,000,000	90,185,860.00	2.12
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				39,136,889	376,011,401.43	8.84
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,285,229,203.45	77.25
REPORTO						
BI	CETES	260416	mxAAA	25,373,588	250,201,939.14	5.88
LF	BONDES F	300124	mxAAA	2,393,636	237,372,191.15	5.58
LF	BONDES F	281228	mxAAA	1,829,133	182,188,586.64	4.28
LF	BONDES F	270930	mxAAA	1,501,653	150,120,466.20	3.53
TOTAL REPORTO					819,883,183.13	19.28
OTROS VALORES				1,443,000	147,351,479.94	3.47
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,252,463,866.52	100.00

	CATEGORÍA		
	IDCPGUB		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR	
AAA/1 HR	0.004%	0.030%	

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