

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL						
MS	BONOS	350524	mxAAA	250,000	24,219,241.50	3.83
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	270114	mxAAA	200,000	19,990,345.80	3.16
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	310529	mxAAA	450,000	44,966,973.15	7.12
M	BONOS	341123	mxAAA	450,000	43,574,202.90	6.90
M	BONOS	290531	mxAAA	400,000	41,519,360.00	6.57
M	BONOS	330526	mxAAA	400,000	38,695,787.60	6.12
M	BONOS	381118	mxAAA	300,000	29,495,606.10	4.67
M	BONOS	361120	mxAAA	250,000	27,767,036.50	4.39
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	311127	mxAAA	47,994	39,179,416.92	6.20
S	UDIBONO	351122	mxAAA	29,665	27,004,810.61	4.27
S	UDIBONO	281130	mxAAA	17,328	15,277,757.56	2.42
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BMIFEL	23V	AA+(mex)	150,000	15,029,884.05	2.38
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
CD	BACMEXT	25	AAA.mx	300,000	30,077,169.60	4.76
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	LAB	23-2	AA+(mex)	263,750	26,587,112.23	4.21
91	GMFIN	24-2	mxAAA	187,536	20,631,576.69	3.27
91	AGUA	17-2X	mxA+	191,594	19,348,144.04	3.06
91	SIGMA	24	AAA.mx	160,000	16,005,997.28	2.53
91	ACTINVR	24	AA-(mex)	129,800	13,055,890.69	2.07
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	SABADEL	25007	HR1	200,000	20,066,408.60	3.18
F	BBASE	25011	mxA-2	200,000	20,004,140.20	3.17
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					532,496,862.02	84.28
REPORTO						
BI	CETES	270513	mxAAA	8,357,923	76,521,510.18	12.11
TOTAL REPORTO					76,521,510.18	12.11
OTROS VALORES				12,415,695	22,833,559.92	3.61
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					631,851,932.12	100.00

CATEGORÍA
IDLP

CALIFICACIÓN
AA/3 HR

VaR Promedio
0.281%

Límite de VaR
0.430%

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