

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDESG	260716	mxAAA	500,000	49,998,728.50	2.36
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	500,000	50,479,196.50	2.38
IQ	BPAG91	270909	mxAAA	500,000	50,070,783.00	2.36
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	SCOTIAB	24V	mxAAA	500,000	50,300,324.00	2.38
94	BBVAMX	23-2	mxAAA	500,000	50,015,201.50	2.36
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
CD	BACMEXT	23-3X	AAA.mx	500,000	50,213,955.50	2.37
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO				1,050,000	105,274,030.00	4.97
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	SABADEL	25008	HR1	900,000	90,167,209.20	4.26
F	BINVEX	26007	mxA-1+	600,000	60,024,874.20	2.83
F	BINVEX	25039	mxA-1+	500,000	50,262,511.50	2.37
F	BACTINV	26006	HR1	500,000	50,219,596.50	2.37
F	BBASE	25019	mxA-2	500,000	50,166,024.00	2.37
F	BINVEX	25024	mxA-1+	500,000	50,156,902.50	2.37
F	BBASE	25011	mxA-2	500,000	50,155,858.00	2.37
F	BMONEX	30766	mxA-1	500,000	50,152,294.50	2.37
F	BMONEX	30266	mxA-1	500,000	50,148,394.00	2.37
F	BACTINV	25014	HR1	500,000	50,104,414.00	2.37
F	BBASE	25026	mxA-2	500,000	50,072,494.00	2.36
F	BBASE	25014	mxA-2	500,000	50,020,728.50	2.36
OTROS TIPO DE VALOR F - CERTIFICADOS DE DEPÓSITO				1,100,000	110,392,928.00	5.21
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	SABADEL	2928701		295,302,547	296,878,309.27	14.02
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,465,274,757.17	69.20
REPORTO						
LF	BONDESF	290719	mxAAA	2,367,861	236,353,720.18	11.16
BI	CETES	261001	mxAAA	18,718,137	180,407,913.94	8.52
BI	CETES	270318	mxAAA	8,205,303	76,404,855.00	3.61
LF	BONDESF	270930	mxAAA	603,736	60,211,557.38	2.84
TOTAL REPORTO					553,378,046.50	26.13
OTROS VALORES				988,450	98,880,167.66	4.67
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,117,532,971.33	100.00

CATEGORÍA
IDCP

CALIFICACIÓN
AAA/1 HR

VaR Promedio
0.002%

Límite de VaR
0.040%

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

LIC. FANNY LORENA RODRIGUEZ GUTIERREZ