

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				3,251,196	325,567,719.16	5.24
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDESG	270506	mxAAA	1,241,684	124,484,951.19	2.00
OTROS TIPO DE VALOR LG - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G				3,500,000	350,231,428.40	5.63
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 ADICIONA				2,200,000	220,033,301.20	3.54
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 ADICION				1,592,000	159,758,820.34	2.57
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				6,655,608	667,273,666.00	10.74
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO				6,423,057	644,235,934.87	10.36
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				6,223,175	621,314,186.58	10.00
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				5,072,157	509,622,922.85	8.20
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	140,515,246.90	2.26
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
OTROS TIPO DE VALOR F - CERTIFICADOS DE DEPÓSITO				13,550,000	1,359,182,459.85	21.87
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				21,000,000	203,349,759.00	3.27
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	SABADEL	2928101		311,542,140	313,333,535.65	5.04
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,638,903,931.99	90.72
REPORTO						
BI	CETES	270121	mxAAA	24,735,330	232,467,022.49	3.74
IM	BPAG28	270506	mxAAA	1,985,791	198,323,231.39	3.19
TOTAL REPORTO					430,790,253.88	6.93
OTROS VALORES				2,386,989	146,063,932.10	2.35
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,215,758,117.97	100.00

CATEGORÍA

IDCP

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

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