

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				2,441,196	244,215,287.94	3.91
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
OTROS TIPO DE VALOR LG - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G				4,041,684	404,356,568.17	6.48
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	219,922,017.70	3.52
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				2,092,000	210,613,023.23	3.37
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				6,749,108	676,703,619.71	10.84
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO				6,423,057	643,841,402.50	10.31
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				6,684,087	667,567,868.81	10.69
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				5,077,157	509,994,668.16	8.17
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				2,700,000	270,593,872.10	4.33
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
OTROS TIPO DE VALOR F - CERTIFICADOS DE DEPÓSITO				14,350,000	1,439,011,424.45	23.05
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				21,000,000	204,340,763.00	3.27
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	SABADEL	2928101		313,210,584	314,881,904.55	5.04
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,806,042,420.32	93.01
REPORTO						
IS	BPA182	300328	mxAAA	3,002,021	309,396,234.34	4.96
BI	CETES	261001	mxAAA	13,193,467	127,160,403.79	2.04
TOTAL REPORTO					436,556,638.13	6.99
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,242,599,058.45	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 dia, con 500 observaciones al 95% de nivel de confianza.