

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	280224	mxAAA	1,500,000	149,652,004.50	2.96
LF	BONDES F	270909	mxAAA	1,400,000	139,822,774.00	2.76
LF	BONDES F	261231	mxAAA	1,367,063	136,726,646.00	2.70
LF	BONDES F	270923	mxAAA	1,268,864	127,063,378.61	2.51
LF	BONDES F	270128	mxAAA	1,020,000	102,021,254.76	2.02
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				8,126,600	813,276,735.70	16.07
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDES G	270218	mxAAA	1,200,000	120,173,781.60	2.37
LG	BONDES G	270506	mxAAA	1,150,000	115,293,177.55	2.28
OTROS TIPO DE VALOR LG - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G				2,300,000	230,131,710.60	4.55
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	261105	mxAAA	1,400,000	140,041,168.40	2.77
OTROS TIPO DE VALOR IM - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONA				2,993,700	299,271,745.58	5.91
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	270506	mxAAA	1,700,000	170,619,323.60	3.37
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	1,150,000	115,538,071.20	2.28
OTROS TIPO DE VALOR IQ - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICION				2,743,000	276,935,882.33	5.47
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260723	mxAAA	17,000,000	165,369,727.00	3.27
BI	CETES	260312	mxAAA	15,000,000	149,704,455.00	2.96
BI	CETES	260514	mxAAA	15,000,000	147,897,045.00	2.92
BI	CETES	260319	mxAAA	12,000,000	119,600,808.00	2.36
BI	CETES	260305	mxAAA	11,368,000	113,612,326.30	2.25
BI	CETES	260416	mxAAA	11,288,761	111,905,589.39	2.21
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				70,136,889	666,211,024.23	13.17
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,410,868,629.35	87.16
REPORTO						
IS	BPA182	300328	mxAAA	3,145,884	320,989,385.29	6.34
LF	BONDES F	261231	mxAAA	2,787,940	278,487,623.72	5.50
TOTAL REPORTO					599,477,009.01	11.85
OTROS VALORES				500,000	50,092,390.00	0.99
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,060,438,028.36	100.00

CATEGORÍA		
IDCPGUB		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite 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.