

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				602,488	60,403,620.33	2.80
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDESG	260716	mxAAA	500,000	50,199,018.50	2.33
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	270909	mxAAA	500,000	50,581,557.50	2.34
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BBVAMX	23-2	mxAAA	500,000	50,213,663.50	2.33
94	SCOTIAB	24V	mxAAA	500,000	50,199,525.00	2.33
94	HSBC	24	AAA.mx	500,000	50,057,554.50	2.32
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				600,000	60,077,149.60	2.78
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
CD	BACMEXT	23-3X	AAA.mx	500,000	50,130,280.00	2.32
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO				1,050,000	105,143,770.50	4.87
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	SABADEL	25008	HR1	900,000	90,034,560.00	4.17
F	BINVEEX	26007	mxA-1+	600,000	60,274,482.60	2.79
F	BBASE	25026	mxA-2	500,000	50,278,660.50	2.33
F	BBASE	25014	mxA-2	500,000	50,228,735.50	2.33
F	BINVEEX	25039	mxA-1+	500,000	50,181,026.00	2.33
F	BACTINV	26006	HR1	500,000	50,109,965.00	2.32
F	BBASE	25019	mxA-2	500,000	50,087,645.00	2.32
F	BINVEEX	26012	mxA-1+	500,000	50,078,800.50	2.32
F	BMONEX	30766	mxA-1	500,000	50,071,100.50	2.32
F	BMONEX	30266	mxA-1	500,000	50,069,148.00	2.32
F	BACTINV	25014	HR1	500,000	50,038,789.50	2.32
F	BBASE	26007	mxA-2	500,000	50,029,008.50	2.32
F	BKAPITL	26004		500,000	50,010,895.50	2.32
OTROS TIPO DE VALOR F - CERTIFICADOS DE DEPÓSITO				1,100,000	110,445,366.70	5.12
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	SABADEL	2928701		298,632,963	299,423,353.28	13.88
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,638,367,676.51	75.94
REPORTO						
LF	BONDESF	280330	mxAAA	2,994,875	299,434,561.21	13.88
LF	BONDESF	300124	mxAAA	1,869,214	186,468,069.12	8.64
TOTAL REPORTO					485,902,630.33	22.52
OTROS VALORES				332,500	33,309,425.07	1.54
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,157,579,731.91	100.00

**CATEGORÍA
IDCP**
CALIFICACIÓN
AAA/1 HR

VaR Promedio
0.002%

Límite de VaR
0.040%

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