

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL						
MS	BONOS	350524	mxAAA	250,000	23,816,629.00	4.18
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	270114	mxAAA	200,000	20,072,020.80	3.52
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	310529	mxAAA	450,000	44,196,253.65	7.75
M	BONOS	290531	mxAAA	400,000	40,828,994.40	7.16
M	BONOS	330526	mxAAA	400,000	37,897,798.00	6.65
M	BONOS	361120	mxAAA	250,000	27,095,860.25	4.75
M	BONOS	341123	mxAAA	250,000	23,663,557.25	4.15
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	311127	mxAAA	47,994	39,031,942.97	6.85
S	UDIBONO	351122	mxAAA	29,665	26,350,198.73	4.62
S	UDIBONO	281130	mxAAA	17,328	15,327,144.50	2.69
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BINVEX	26	AA-.mx	300,000	30,018,611.40	5.27
94	BMONEX	26	AA(mex)	200,000	20,123,654.40	3.53
94	BMIFEL	23V	AA+(mex)	150,000	15,003,435.75	2.63
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
CD	BACMEXT	26X	AAA(mex)	200,000	20,761,271.20	3.64
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	LAB	23-2	AA+(mex)	263,750	26,498,252.75	4.65
91	GMFIN	24-2	mxAAA	187,536	20,132,092.93	3.53
91	SIGMA	24	AAA.mx	160,000	16,074,746.88	2.82
91	ACTINVR	24	AA-(mex)	129,800	13,041,770.78	2.29
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	SABADEL	25007	HR1	200,000	20,034,507.00	3.52
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	SABADEL	2931601		12,593,275	12,650,866.04	2.22
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					492,619,608.68	86.44
REPORTO						
BI	CETES	280412	mxAAA	6,980,844	61,018,013.56	10.71
TOTAL REPORTO					61,018,013.56	10.71
OTROS VALORES				160,257	16,284,942.07	2.86
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					569,922,564.31	100.00

**CATEGORÍA
IDLP**
CALIFICACIÓN
AA/3 HR

VaR Promedio
0.261%

Límite de VaR
0.430%

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