

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	261231	mxAAA	1,467,063	146,870,266.30	3.15
LF	BONDES F	270128	mxAAA	1,020,000	102,105,224.22	2.19
LF	BONDES F	261022	mxAAA	999,918	100,366,639.26	2.15
LF	BONDES F	270909	mxAAA	1,000,000	100,011,443.00	2.15
LF	BONDES F	280615	mxAAA	1,000,000	99,848,787.00	2.14
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				4,037,058	404,272,784.09	8.67
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDES G	270218	mxAAA	1,200,000	120,266,871.60	2.58
LG	BONDES G	270506	mxAAA	1,150,000	115,376,736.55	2.48
LG	BONDES G	260716	mxAAA	1,000,000	100,140,551.00	2.15
OTROS TIPO DE VALOR LG - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G				1,400,000	139,845,389.60	3.00
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 ADICIONAL				1,000,000	100,218,701.00	2.15
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	270506	mxAAA	1,700,000	171,503,214.80	3.68
IQ	BPAG91	270107	mxAAA	1,000,000	101,463,037.00	2.18
IQ	BPAG91	270909	mxAAA	1,000,000	100,142,575.00	2.15
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	930,000	93,369,624.78	2.00
OTROS TIPO DE VALOR IQ - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL				1,313,000	132,376,556.63	2.84
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260723	mxAAA	17,000,000	169,175,262.00	3.63
BI	CETES	260806	mxAAA	15,354,700	152,420,594.56	3.27
BI	CETES	260709	mxAAA	15,000,000	149,648,745.00	3.21
BI	CETES	260820	mxAAA	12,314,712	121,936,226.68	2.62
BI	CETES	260903	mxAAA	10,000,000	98,769,500.00	2.12
BI	CETES	261112	mxAAA	10,000,000	97,494,040.00	2.09
BI	CETES	261210	mxAAA	10,000,000	97,007,260.00	2.08
BI	CETES	270107	mxAAA	10,000,000	96,484,960.00	2.07
BI	CETES	270121	mxAAA	10,000,000	96,213,150.00	2.06
BI	CETES	270318	mxAAA	10,000,000	95,201,510.00	2.04
BI	CETES	270624	mxAAA	10,000,000	93,365,500.00	2.00
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				59,830,500	573,648,120.23	12.31
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,969,543,270.30	85.17
REPORTO						
BI	CETES	280412	mxAAA	28,606,750	250,045,275.24	5.36
LF	BONDES F	281228	mxAAA	1,510,186	150,027,082.73	3.22
LF	BONDES F	310320	mxAAA	1,420,480	141,036,851.18	3.03
BI	CETES	280608	mxAAA	11,574,766	100,018,105.20	2.15
TOTAL REPORTO					641,127,314.35	13.76
OTROS VALORES				500,000	50,131,851.00	1.08
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,660,802,435.65	100.00

**CATEGORÍA
IDCPGUB**
CALIFICACIÓN
AAA/1 HR

VaR Promedio
0.005%

Límite de VaR
0.030%

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