

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	147,140,609.33	3.15
LF	BONDES F	270128	mxAAA	1,120,000	112,326,325.44	2.41
LF	BONDES F	261022	mxAAA	999,918	100,049,090.30	2.15
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				3,841,526	384,680,694.05	8.25
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDES G	270218	mxAAA	1,200,000	120,493,526.40	2.58
LG	BONDES G	270506	mxAAA	1,150,000	115,014,969.55	2.47
LG	BONDES G	281019	mxAAA	1,000,000	99,758,736.00	2.14
OTROS TIPO DE VALOR LG - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G				1,400,000	140,169,485.40	3.01
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	260806	mxAAA	1,000,000	100,450,659.00	2.15
OTROS TIPO DE VALOR IM - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONA				1,000,000	100,159,514.50	2.15
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	1,930,000	195,095,128.87	4.18
IQ	BPAG91	270506	mxAAA	1,700,000	172,714,643.30	3.70
IQ	BPAG91	270909	mxAAA	1,000,000	100,834,989.00	2.16
IQ	BPAG91	270107	mxAAA	1,000,000	100,408,617.00	2.15
OTROS TIPO DE VALOR IQ - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONA				1,313,000	132,239,233.72	2.84
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	261022	mxAAA	20,000,000	197,137,220.00	4.23
BI	CETES	270107	mxAAA	17,000,000	165,149,339.00	3.54
BI	CETES	260806	mxAAA	15,354,700	153,463,393.66	3.29
BI	CETES	260820	mxAAA	12,314,712	122,772,765.07	2.63
BI	CETES	260903	mxAAA	10,000,000	99,455,320.00	2.13
BI	CETES	261112	mxAAA	10,000,000	98,179,820.00	2.11
BI	CETES	261210	mxAAA	10,000,000	97,655,460.00	2.09
BI	CETES	270121	mxAAA	10,000,000	96,886,870.00	2.08
BI	CETES	270318	mxAAA	10,000,000	95,878,520.00	2.06
BI	CETES	270624	mxAAA	10,000,000	94,100,730.00	2.02
BI	CETES	270708	mxAAA	10,000,000	93,827,270.00	2.01
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				52,111,500	504,783,805.33	10.82
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,940,826,734.92	84.49
REPORTO						
LG	BONDES G	281019	mxAAA	2,014,207	200,933,301.44	4.31
BI	CETES	280412	mxAAA	22,692,277	200,109,663.42	4.29
LF	BONDES F	280224	mxAAA	1,502,961	150,081,702.12	3.22
IQ	BPAG91	300110	mxAAA	1,225,439	122,033,550.86	2.62
TOTAL REPORTO					673,158,217.84	14.43
OTROS VALORES				500,000	50,226,422.00	1.08
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,664,211,374.76	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAA/1 HR

VaR Promedio
0.005%

Límite de VaR
0.030%

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

LIC. FANNY LORENA RODRIGUEZ GUTIERREZ