

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				2,415,256	242,169,328.59	3.90
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDESG	281019	mxAAA	1,500,000	149,758,447.50	2.41
LG	BONDESG	270506	mxAAA	1,241,684	124,268,192.90	2.00
OTROS TIPO DE VALOR LG - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G				1,700,000	170,456,245.30	2.75
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN						
IS	BPA182	270401	mxAAA	1,500,000	155,414,526.00	2.51
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
OTROS TIPO DE VALOR IQ - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL				1,494,069	150,270,325.27	2.42
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				7,631,710	765,883,498.60	12.35
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO				7,312,557	732,867,372.79	11.82
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				4,421,441	443,834,439.26	7.16
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				4,521,984	453,384,548.06	7.31
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL				2,600,000	261,570,605.50	4.22
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
OTROS TIPO DE VALOR F - CERTIFICADOS DE DEPÓSITO				15,350,000	1,539,848,481.60	24.83
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				37,000,000	351,500,350.00	5.67
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	SABADEL	2928101		324,472,953	326,266,357.85	5.26
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,867,492,719.22	94.60
REPORTO						
LF	BONDESF	300124	mxAAA	1,847,554	184,364,520.79	2.97
TOTAL REPORTO					184,364,520.79	2.97
OTROS VALORES				1,500,000	150,327,208.50	2.42
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,202,184,448.51	100.00

CATEGORÍA

IDCP

CALIFICACIÓN

AAA/1 HR

VaR Promedio

0.003%

Límite de VaR

0.040%

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