

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDESF	280831	mxAAA	2,000,000	200,464,016.00	2.62
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				12,720,796	1,275,220,931.49	16.69
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
OTROS TIPO DE VALOR LG - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G				5,750,000	575,195,806.55	7.53
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	270506	mxAAA	1,700,000	171,577,530.30	2.25
OTROS TIPO DE VALOR IQ - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL				3,513,000	354,273,352.20	4.64
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	261231	mxAAA	20,000,000	196,674,080.00	2.57
BI	CETES	270401	mxAAA	20,000,000	193,201,880.00	2.53
BI	CETES	270915	mxAAA	20,000,000	186,596,600.00	2.44
BI	CETES	270107	mxAAA	17,000,000	166,947,531.00	2.18
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				180,241,192	1,738,480,704.55	22.75
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,058,632,432.09	66.19
REPORTO						
BI	CETES	280412	mxAAA	75,677,231	673,442,899.28	8.81
BI	CETES	280412	mxAAA	64,807,601	576,670,596.74	7.55
LF	BONDESF	290111	mxAAA	3,624,504	360,066,520.90	4.71
LF	BONDESF	300124	mxAAA	3,437,319	343,004,680.90	4.49
LF	BONDESF	300124	mxAAA	3,175,046	316,239,672.78	4.14
LF	BONDESF	291101	mxAAA	2,144,321	214,194,687.70	2.80
TOTAL REPORTO					2,483,619,058.30	32.50
OTROS VALORES				1,000,000	100,227,668.50	1.31
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					7,642,479,158.89	100.00

CATEGORÍA

IDCPGUB

CALIFICACIÓN

AAA/1 HR

VaR Promedio

0.006%

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.