

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				4,103,196	411,350,578.07	6.67
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDESG	270506	mxAAA	1,241,684	124,267,537.29	2.01
OTROS TIPO DE VALOR LG - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G				2,600,000	260,502,859.50	4.22
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 ADICIONA				3,700,000	370,337,183.60	6.00
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				7,381,225	741,158,249.60	12.02
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO				5,623,057	564,281,497.02	9.15
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				5,430,400	542,289,313.44	8.79
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				3,775,945	378,633,536.46	6.14
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				1,400,000	140,695,851.10	2.28
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
OTROS TIPO DE VALOR F - CERTIFICADOS DE DEPÓSITO				14,750,000	1,479,804,745.30	23.99
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				26,500,000	253,835,440.00	4.12
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	SABADEL	2928101		294,081,693	295,911,844.49	4.80
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,563,068,635.87	90.19
REPORTO						
LF	BONDESF	270422	mxAAA	1,453,478	145,164,304.93	2.35
BI	CETES	270318	mxAAA	15,431,002	140,071,621.67	2.27
TOTAL REPORTO					285,235,926.60	4.62
OTROS VALORES				14,041,746	320,012,759.11	5.19
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,168,317,321.58	100.00

CATEGORÍA
IDCP

CALIFICACIÓN
AAA/1 HR

VaR Promedio
0.002%

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.