

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				4,101,196	410,332,357.92	6.70
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDESG	270506	mxAAA	1,241,684	123,993,501.36	2.02
OTROS TIPO DE VALOR LG - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G				3,100,000	310,610,499.40	5.07
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	370,297,826.00	6.04
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				7,007,168	703,070,570.66	11.48
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO				6,123,057	614,294,353.24	10.03
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				5,676,674	566,067,099.65	9.24
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				3,775,945	378,558,507.86	6.18
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	140,822,404.10	2.30
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
OTROS TIPO DE VALOR F - CERTIFICADOS DE DEPÓSITO				13,350,000	1,339,705,158.95	21.87
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	254,760,792.50	4.16
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	SABADEL	2928101		295,849,400	296,941,782.10	4.85
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,509,454,853.74	89.92
REPORTO						
LF	BONDEF	300124	mxAAA	1,990,360	198,211,664.37	3.24
LG	BONDESG	280316	mxAAA	1,890,664	189,263,046.76	3.09
LG	BONDESG	260319	mxAAA	1,394,210	140,028,186.45	2.29
TOTAL REPORTO					527,502,897.58	8.61
OTROS VALORES				892,000	89,792,811.02	1.47
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,126,750,562.34	100.00

CATEGORÍA		
IDCP		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAA/1 HR	0.002%	0.040%

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