

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDESF	260604	mxAAA	821,378	82,128,846.16	2.15
LF	BONDESF	270930	mxAAA	792,664	79,395,764.35	2.08
LF	BONDESF	261231	mxAAA	767,063	76,875,544.01	2.01
LF	BONDESF	270923	mxAAA	768,864	76,689,821.47	2.01
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				3,706,158	370,461,648.25	9.69
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDESG	270218	mxAAA	1,200,000	120,375,142.80	3.15
LG	BONDESG	270506	mxAAA	1,150,000	114,838,015.60	3.00
LG	BONDESG	260716	mxAAA	1,000,000	100,258,333.00	2.62
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	261105	mxAAA	1,000,000	100,236,649.00	2.62
IM	BPAG28	270805	mxAAA	940,500	94,236,538.77	2.46
IM	BPAG28	270204	mxAAA	800,000	80,020,928.00	2.09
OTROS TIPO DE VALOR IM - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONA				2,400,000	240,177,728.00	6.28
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN						
IS	BPA182	260219	mxAAA	800,000	82,109,733.60	2.15
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	270506	mxAAA	1,700,000	171,364,204.10	4.48
IQ	BPAG91	270107	mxAAA	1,000,000	101,389,592.00	2.65
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	830,000	83,220,430.57	2.18
OTROS TIPO DE VALOR IQ - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICION				1,450,000	145,950,946.00	3.82
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260219	mxAAA	18,000,000	177,855,840.00	4.65
BI	CETES	260122	mxAAA	10,000,000	99,343,700.00	2.60
BI	CETES	270708	mxAAA	10,000,000	89,065,160.00	2.33
BI	CETES	251224	mxAAA	8,000,000	79,920,168.00	2.09
BI	CETES	260305	mxAAA	8,000,000	78,811,760.00	2.06
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				37,296,000	364,113,554.75	9.52
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,008,840,048.43	78.67
REPORTO						
LF	BONDESF	260423	mxAAA	2,493,551	250,050,330.09	6.54
BI	CETES	270121	mxAAA	24,024,020	220,768,695.12	5.77
LF	BONDESF	280928	mxAAA	1,900,922	189,667,381.94	4.96
TOTAL REPORTO					660,486,407.15	17.27
OTROS VALORES				1,547,616	155,178,209.71	4.06
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,824,504,665.29	100.00

	CATEGORÍA	
	IDCPGUB	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAA/1 HR	0.004%	0.030%

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