

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	260604	mxAAA	821,378	82,242,896.14	2.14
LF	BONDES F	270930	mxAAA	792,664	79,075,233.22	2.06
LF	BONDES F	261231	mxAAA	767,063	76,982,551.60	2.00
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				4,475,022	447,773,420.01	11.66
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDES G	270218	mxAAA	1,200,000	119,889,370.80	3.12
LG	BONDES G	270506	mxAAA	1,150,000	114,998,456.70	2.99
LG	BONDES G	260716	mxAAA	1,000,000	100,393,740.00	2.61
OTROS TIPO DE VALOR LG - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G				1,300,000	129,829,448.30	3.38
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	261105	mxAAA	1,000,000	100,382,177.00	2.61
IM	BPAG28	270805	mxAAA	940,500	93,852,416.94	2.44
IM	BPAG28	270204	mxAAA	800,000	80,141,054.40	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	240,148,725.10	6.25
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN						
IS	BPA182	260219	mxAAA	800,000	82,237,185.60	2.14
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	270506	mxAAA	1,700,000	171,614,653.20	4.47
IQ	BPAG91	270107	mxAAA	1,000,000	101,536,935.00	2.64
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	830,000	83,352,228.76	2.17
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	146,170,273.30	3.81
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260219	mxAAA	18,000,000	178,061,616.00	4.64
BI	CETES	260122	mxAAA	10,000,000	99,473,280.00	2.59
BI	CETES	270708	mxAAA	10,000,000	89,187,080.00	2.32
BI	CETES	260305	mxAAA	8,000,000	78,914,280.00	2.05
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				37,296,000	364,622,745.65	9.49
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,060,879,767.72	79.69
REPORTO						
LF	BONDES F	280622	mxAAA	2,261,661	224,932,797.09	5.86
BI	CETES	260416	mxAAA	19,511,762	190,668,203.63	4.96
IS	BPA182	320324	mxAAA	1,487,970	150,059,599.62	3.91
IM	BPAG28	270204	mxAAA	1,497,957	150,059,538.74	3.91
TOTAL REPORTO					715,720,139.08	18.63
OTROS VALORES				643,000	64,318,603.05	1.67
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,840,918,509.85	100.00

CATEGORÍA		
IDCPGUB		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite 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.