

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	260326	mxAAA	600,000	60,254,677.20	3.08
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				789,950	79,182,332.84	4.05
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDES G	260716	mxAAA	500,000	50,196,870.00	2.57
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BBVAMX	23-2	mxAAA	500,000	50,240,535.50	2.57
94	SCOTIAB	24V	mxAAA	500,000	50,172,328.50	2.57
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
CD	BACMEXT	23-3X	AAA,mx	500,000	50,141,571.50	2.56
CD	BANOB	25	mxAAA	400,000	40,023,758.40	2.05
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO				450,000	45,110,109.05	2.31
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	SABADEL	25008	HR1	900,000	90,037,410.30	4.60
F	BINVEX	25018	mxA-1+	600,000	60,293,650.80	3.08
F	BBASE	25026	mxA-2	500,000	50,309,486.50	2.57
F	BBASE	25014	mxA-2	500,000	50,244,709.00	2.57
F	SABADEL	25001	HR1	500,000	50,234,346.50	2.57
F	BINVEX	25039	mxA-1+	500,000	50,193,776.00	2.57
F	BBASE	25019	mxA-2	500,000	50,094,646.50	2.56
F	BINVEX	25024	mxA-1+	500,000	50,084,467.00	2.56
F	BBASE	25011	mxA-2	500,000	50,083,909.00	2.56
F	BMONEX	30766	mxA-1	500,000	50,076,645.00	2.56
F	BMONEX	30266	mxA-1	500,000	50,074,691.50	2.56
F	BACTINV	25014	HR1	500,000	50,041,956.50	2.56
F	BBASE	25021	mxA-2	400,000	40,178,514.80	2.05
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	SABADEL	2928701		290,029,383	291,509,599.86	14.90
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,408,779,992.25	72.02
REPORTO						
LF	BONDES F	261231	mxAAA	2,878,422	288,454,493.42	14.75
IM	BPAG28	270204	mxAAA	998,638	100,039,692.49	5.11
IS	BPA182	320324	mxAAA	598,056	60,313,073.45	3.08
TOTAL REPORTO					448,807,259.36	22.94
OTROS VALORES				989,641	98,432,212.93	5.03
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,956,019,464.54	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.

LIC. FANNY LORENA RODRIGUEZ GUTIERREZ