

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDES D	251211	mxAAA	1,130,000	113,418,262.72	2.32
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	270422	mxAAA	1,329,452	133,382,904.79	2.73
LF	BONDES F	261001	mxAAA	1,027,554	102,768,759.23	2.10
LF	BONDES F	261203	mxAAA	1,000,000	100,433,887.00	2.05
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				9,591,824	960,865,626.71	19.63
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDES G	270218	mxAAA	1,200,000	119,923,872.00	2.45
LG	BONDES G	270506	mxAAA	1,150,000	115,090,626.90	2.35
LG	BONDES G	260716	mxAAA	1,000,000	100,470,019.00	2.05
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG 28	261105	mxAAA	1,000,000	100,429,911.00	2.05
OTROS TIPO DE VALOR IM - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONA				4,840,500	484,678,288.61	9.90
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG 91	270506	mxAAA	1,700,000	173,127,462.80	3.54
IQ	BPAG 91	270107	mxAAA	1,000,000	100,402,320.00	2.05
OTROS TIPO DE VALOR IQ - BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICION				2,280,000	231,476,198.95	4.73
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	251120	mxAAA	10,000,000	99,649,850.00	2.04
BI	CETES	251211	mxAAA	10,000,000	99,241,570.00	2.03
BI	CETES	260122	mxAAA	10,000,000	98,409,990.00	2.01
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				76,296,000	734,443,289.58	15.01
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,868,212,839.29	79.03
REPORTO						
LF	BONDES F	300321	mxAAA	2,307,576	230,147,102.75	4.70
BI	CETES	270318	mxAAA	22,121,274	200,127,496.68	4.09
LF	BONDES F	261231	mxAAA	1,994,952	200,127,259.48	4.09
LF	BONDES F	281228	mxAAA	1,826,785	182,266,239.41	3.72
TOTAL REPORTO					812,668,098.32	16.60
OTROS VALORES				2,123,000	213,743,262.13	4.37
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,894,624,199.74	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.