

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	59,997,619.20	3.12
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				822,088	82,371,563.98	4.29
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES G						
LG	BONDES G	260716	mxAAA	500,000	49,984,029.00	2.60
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	SCOTIAB	24V	mxAAA	500,000	50,256,013.50	2.62
94	BSMX	23-3	AAA.mx	500,000	50,205,710.50	2.61
94	BBVAMX	23-2	mxAAA	500,000	50,022,538.00	2.60
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				525,000	52,736,043.45	2.75
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
CD	BACMEXT	23-3X	AAA.mx	500,000	50,250,407.00	2.62
CD	NAFR	23-2S	mxAAA	500,000	50,151,857.00	2.61
CD	BANOB	25	mxAAA	400,000	40,095,776.80	2.09
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO				450,000	45,166,839.85	2.35
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	SABADEL	25008	HR1	900,000	90,178,911.90	4.69
F	BINVEX	25018	mxA-1+	600,000	60,026,508.60	3.12
F	BINVEX	25039	mxA-1+	500,000	50,281,261.00	2.62
F	BBASE	25019	mxA-2	500,000	50,177,803.50	2.61
F	BINVEX	25024	mxA-1+	500,000	50,167,737.50	2.61
F	BBASE	25011	mxA-2	500,000	50,166,693.00	2.61
F	BMONEX	30266	mxA-1	500,000	50,158,507.50	2.61
F	BACTINV	24012	HR1	500,000	50,122,554.00	2.61
F	BBASE	25014	mxA-2	500,000	50,022,090.50	2.60
F	SABADEL	25001	HR1	500,000	50,011,055.50	2.60
F	BBASE	25021	mxA-2	400,000	40,248,888.80	2.10
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	SABADEL	2928701		288,296,451	288,663,488.36	15.03
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,461,463,898.44	76.08
REPORTO						
LF	BONDES F	261001	mxAAA	2,186,563	218,562,450.04	11.38
LF	BONDES F	270617	mxAAA	1,308,016	131,027,305.93	6.82
M	BONOS	290531	mxAAA	619,216	64,388,745.34	3.35
TOTAL REPORTO					413,978,501.31	21.55
OTROS VALORES				453,077	45,468,592.98	2.37
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,920,910,992.73	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 dia, con 500 observaciones al 95% de nivel de confianza.