

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL						
MS	BONOS	350524	mxAAA	300,000	29,525,083.50	4.05
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	270114	mxAAA	200,000	20,039,403.60	2.75
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	330526	mxAAA	700,000	68,147,682.40	9.36
M	BONOS	310529	mxAAA	450,000	45,322,321.05	6.22
M	BONOS	341123	mxAAA	450,000	43,859,804.85	6.02
M	BONOS	290531	mxAAA	400,000	42,076,550.80	5.78
M	BONOS	381118	mxAAA	300,000	29,638,292.40	4.07
M	BONOS	361120	mxAAA	250,000	28,070,785.00	3.85
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	311127	mxAAA	47,994	37,969,762.66	5.21
S	UDIBONO	351122	mxAAA	29,665	25,725,448.25	3.53
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BMIFEL	23V	AA+(mex)	150,000	15,080,653.95	2.07
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
CD	BACMEXT	25	AAA.mx	300,000	30,170,993.40	4.14
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	LAB	23-2	AA+(mex)	263,750	26,631,562.29	3.66
91	GMFIN	24-2	mxAAA	187,536	19,994,753.19	2.75
91	AGUA	17-2X	mxA+	191,594	19,611,570.65	2.69
91	SIGMA	24	AAA.mx	160,000	16,056,615.04	2.20
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				229,800	23,610,262.38	3.24
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	BBASE	25011	mxA-2	200,000	20,066,677.20	2.76
F	SABADEL	25007	HR1	200,000	20,008,780.20	2.75
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					561,607,002.81	77.12
REPORTO						
BI	CETES	261001	mxAAA	16,535,728	154,552,224.42	21.22
TOTAL REPORTO					154,552,224.42	21.22
OTROS VALORES				12,096,095	12,111,494.43	1.66
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					728,270,721.66	100.00

CATEGORÍA
IDLP

CALIFICACIÓN
AA/3 HR

VaR Promedio
0.285%

Límite de VaR
0.430%

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