

T VALOR	EMISORA	SERE	CALIF/ BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				55,626,291	0.74%
CD	NAFR	17S	AA(mex)	55,626,291	0.74%
Certificados de Depósito				1,338,809,145	17.82%
F	BANORTE	18022	F1+(mex)	450,914,972	6.00%
F	BANORTE	18002	F1+(mex)	100,633,111	1.34%
F	BSCTIA	18011	F1+(mex)	100,621,375	1.34%
F	BACOMER	18171	F1+(mex)	100,181,173	1.33%
F	BANSAH	18080	F1+(mex)	100,181,080	1.33%
F	BSCTIA	18019	F1+(mex)	100,091,010	1.33%
F	BRVEX	18041	mxA-1	80,278,159	1.07%
F	BACTIV	18037	HR1	80,278,103	1.07%
F	BANORTE	18020	F1+(mex)	80,198,795	1.07%
F	BACOMER	18140	F1+(mex)	70,173,510	0.93%
F	BANSAH	18028	F1+(mex)	35,222,511	0.47%
F	BANORTE	18008	F1+(mex)	20,072,114	0.27%
F	BACOMER	18153	F1+(mex)	20,063,242	0.27%
Certificados Bursátiles Bancarios				641,574,297	8.54%
94	COMPART	14	AA+(mex)	117,158,240	1.56%
94	BSANT	15	AA(mex)	100,375,840	1.34%
94	SCOTIAB	18	AA(mex)	80,665,112	1.07%
94	BSMX	18	AA(mex)	70,468,997	0.94%
94	BNBUR	18	mxAAA	70,389,574	0.94%
94	BANAMEX	18	AA(mex)	70,349,441	0.94%
94	BACOMER	17	AA(mex)	50,263,070	0.67%
94	BACOMER	18V	AA(mex)	50,211,568	0.67%
94	SCOTIAB	17-3	AA(mex)	10,100,110	0.13%
94	SCOTIAB	15-2	AA(mex)	10,067,955	0.13%
94	BACOMER	16	AA(mex)	10,031,656	0.13%
94	HSBC	17	Aa1.mx	1,692,734	0.02%
Certificados Bursátiles Corporativos				2,835,698,808	37.75%
91	SORIANA	15	AA+(mex)	135,916,641	1.81%
91	LIVPOL	17-2	AA(mex)	130,230,690	1.73%
91	GMFN	17	AA(mex)	120,234,350	1.60%
91	NRF	17	mxAAA	114,288,250	1.52%
91	TELVISA	14	Aa1.mx	105,982,662	1.41%
91	VWLEASE	14-2	mxAAA	105,326,691	1.40%
91	GMXT	17-2	AA(mex)	101,496,252	1.35%
91	GCARSD	18	AA(mex)	100,693,494	1.34%
91	BBVILMEX	18	AA(mex)	100,687,222	1.34%
91	LALA	18-2	AA(mex)	84,972,497	1.13%
91	PCARFM	17	AA(mex)	83,433,911	1.11%
91	ACIE	17-2	AA(mex)	83,024,280	1.11%
91	PCARFM	15	AA(mex)	80,400,010	1.07%
91	GAP	15	mxAAA	78,383,588	1.04%
91	FIJNO	18	AA(mex)	75,186,494	1.00%
91	FORD	14-2	Aa3.mx	75,115,728	1.00%
91	GRUMA	18	mxAAA	75,017,302	1.00%
91	FIJNO	17-2	AA(mex)	74,507,018	0.99%
91	GAP	16	mxAAA	65,788,568	0.88%
91	OSM	15-2	mxAAA	64,514,606	0.86%
91	BACHOCO	17	AA(mex)	60,275,959	0.80%
91	HERDEZ	17-2	AA-(mex)	60,194,025	0.80%
91	DAMLER	17-2	AA(mex)	60,097,000	0.80%
91	TPCB	17	AA(mex)	55,576,027	0.74%
91	SORIANA	16	AA+(mex)	50,348,657	0.67%
91	LALA	18-3	AA(mex)	50,306,659	0.67%
91	BNPPPF	17	AA(mex)	50,279,767	0.67%
91	VWLEASE	17-2	mxAAA	50,218,906	0.67%
91	TOTOTA	17-4	AA(mex)	50,083,741	0.67%
91	KOF	17-2	mxAAA	46,224,960	0.62%
91	BNPPPF	17-2	AA(mex)	45,242,664	0.60%
91	TOTOTA	14	AA(mex)	42,524,805	0.57%
91	HERDEZ	14	AA-(mex)	42,167,256	0.56%
91	GAP	17-2	mxAAA	40,201,912	0.54%
91	NRF	18	mxAAA	40,203,716	0.54%
91	DAMLER	17	AA(mex)	39,985,204	0.52%
91	HOLCMI	15	AA(mex)	36,167,215	0.48%
91	ABCCB	18	mxAAA	26,794,147	0.36%
91	GASN	18-2	mxAAA	26,626,712	0.35%
91	AERMACB	15	HR AA	24,254,344	0.32%
91	BLADEX	16	AA(mex)	20,896,826	0.27%
91	TELVISA	15	Aa1.mx	13,815,305	0.18%
91	CREALCB	17	AA(mex)	10,071,766	0.13%
91	FMN	15	AA(mex)	10,067,006	0.13%
91	MERCFCB	17	mxAAA	10,025,193	0.13%
91	VWLEASE	17	mxAAA	8,192,178	0.11%
91	TOTOTA	15	AA(mex)	6,820,862	0.09%
91	BNPPPF	15	AA(mex)	5,014,682	0.07%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				279,330,176	3.72%
93	VWLEASE	00518	mxA-1+	69,802,123	0.93%
93	GMFN	03318	F1+(mex)	60,287,677	0.80%
93	DAMLER	03418	F1+(mex)	19,947,567	0.27%
93	VWLEASE	00718	mxA-1+	39,826,054	0.53%
93	PCARFM	03218	F1+(mex)	19,912,807	0.27%
93	PCARFM	03318	F1+(mex)	19,892,232	0.27%
93	PCARFM	03118	F1+(mex)	9,971,696	0.13%
Pagaré Rendimiento Liquidable al Vencimiento (PRLVs)				221,351,777	2.95%
I	BACMEX	18395	F1+(mex)	221,351,777	2.95%
Títulos de Organismos Financieros Multilaterales				197,864,803	2.63%
J	CABE	1-17	mxAAA	70,058,069	0.93%
J	IBENV	1-18	mxAAA	64,330,953	0.86%
J	CABE	1-15	mxAAA	48,456,163	0.65%
J	CABE	2-15	mxAAA	15,017,718	0.20%
Certif.Burs.Emis. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				387,744,768	5.16%
95	FEFA	17-2	AA(mex)	131,780,932	1.75%
95	FCOTCB	17	AA(mex)	90,824,236	1.21%
95	FNCDT	18	AA(mex)	70,372,628	0.94%
95	FEFA	17	AA(mex)	49,166,576	0.65%
95	FEFA	17-7	AA(mex)	30,189,262	0.40%
95	FEFA	17-5	AA(mex)	13,464,345	0.18%
95	CFECB	10-2	Aa1.mx	2,017,469	0.03%
Reportos				1,554,383,387	20.69%
94	SCOTIAB	17-3	AA(mex)	466,044,050	6.20%
LD	BONDESID	20070	AA(mex)	388,825,937	5.18%
LD	BONDESID	220512	AA(mex)	266,300,791	3.53%
94	BNBUR	16-2	mxAAA	165,431,345	2.20%
94	BNBUR	17	mxAAA	100,021,813	1.33%
F	BACOMER	21145	AA(mex)	92,810,464	1.24%
94	HSBC	17	Aa1.mx	41,276,444	0.55%
94	BNBUR	16	mxAAA	34,612,683	0.46%
TOTAL CARTERA				7,512,383,451	100.00%
ACTIVO NETO				7,506,062,940	
Cartera al: 27/09/2018					
Límite Máximo de VaR: 0.35%				Var Promedio: 0.0460%	
Parámetros: Modelo Histórico, 7 días con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.					
Límite autorizado por CNBV					
T VALOR	EMISORA	SERE	CALIF/ BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados bursátiles fiduciarios				219,563,282	2.92%
91	ABCCB	18	mxAAA	26,794,147	0.36%
91	AERMACB	15	HR AA+	24,254,344	0.32%
91	TPCB	17	AA(mex)	55,576,027	0.74%
95	FCOTCB	17	AA(mex)	90,824,236	1.21%
95	CFECB	10-2	Aa1.mx	2,017,469	0.03%
91	MERCFCB	17	mxAAA	10,025,193	0.13%
91	CREALCB	17	AA(mex)	10,071,766	0.13%
TOTAL				219,563,282	2.92%

"El riesgo en los instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos en caso de tenerlos en el fondo consiste en movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan al instrumento adquirido. El riesgo se considera alto debido a la existencia de factores de riesgo implícitos como: movimiento de tasas de interés, tipos de cambio o inflación, etc."