

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 28/06/2024
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

| TIPO DE VALOR | EMISORA | SERIE | CALIFICACION / BURSATILIDAD | IMPORTE A MERCADO | % |
|------------------------|---------|--------|-----------------------------|-------------------|-------|
| Gubernamentales | | | | | |
| 95 | CFE | 21-3 | mxAAA | 29,685,166.15 | 0.65% |
| 95 | CFE | 21-4 | mxAAA | 30,030,159.30 | 0.66% |
| 95 | FNCOT | 23S | AAA(mex) | 30,163,344.90 | 0.66% |
| 95 | FNCOT | 24 | AAA(mex) | 40,228,924.40 | 0.89% |
| | | | | 130,107,594.75 | |
| BI | CETES | 240711 | mxA-1+ | 49,846,860.00 | 1.10% |
| BI | CETES | 240725 | mxA-1+ | 69,494,544.00 | 1.53% |
| | | | | 119,341,404.00 | |
| IM | BPAG28 | 270204 | mxAAA | 99,732,635.00 | 2.20% |
| | | | | 99,732,635.00 | |
| IQ | BPAG91 | 240829 | mxAAA | 25,245,145.75 | 0.55% |
| IQ | BPAG91 | 260507 | mxAAA | 76,084,638.00 | 1.68% |
| IQ | BPAG91 | 260903 | mxAAA | 40,219,265.60 | 0.89% |
| IQ | BPAG91 | 290111 | mxAAA | 101,729,779.00 | 2.25% |
| IQ | BPAG91 | 290510 | mxAAA | 50,370,895.50 | 1.11% |
| | | | | 293,649,723.85 | |
| IS | BPA182 | 280412 | mxAAA | 25,470,392.50 | 0.56% |
| IS | BPA182 | 290322 | mxAAA | 31,355,481.00 | 0.69% |
| IS | BPA182 | 300328 | mxAAA | 30,605,368.50 | 0.67% |
| | | | | 87,431,242.00 | |
| LD | BONDES | 260611 | mxAAA | 20,054,068.00 | 0.44% |
| | | | | 20,054,068.00 | |
| LF | BONDES | 240725 | mxAAA | 25,029,387.75 | 0.55% |
| LF | BONDES | 241003 | mxAAA | 40,212,742.40 | 0.89% |
| LF | BONDES | 241024 | mxAAA | 50,371,358.00 | 1.11% |
| LF | BONDES | 241107 | mxAAA | 50,155,284.50 | 1.11% |
| LF | BONDES | 250227 | mxAAA | 20,057,558.40 | 0.44% |
| LF | BONDES | 250327 | mxAAA | 30,085,339.50 | 0.66% |
| LF | BONDES | 250403 | mxAAA | 50,030,797.50 | 1.10% |

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

¹ El riesgo por invertir en certificados bursátiles fiduciarios o valores respaldados por activos en caso de formar parte de la cartera de inversión del fondo radica en el impacto negativo de movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan directamente al subyacente de los instrumentos adquiridos. El riesgo asociado se considera alto debido a la existencia de riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipo de cambio, inflación entre otros, además de que la liquidez de los instrumentos puede verse afectada negativamente en caso de no existir un mercado secundario desarrollado para los mismos.

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 28/06/2024
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

| TIPO DE VALOR | EMISORA | SERIE | CALIFICACION / BURSATILIDAD | IMPORTE A MERCADO | % |
|------------------------|---------|--------|-----------------------------|-------------------|-------|
| Gubernamentales | | | | | |
| LF | BONDESF | 250424 | mxAAA | 30,082,466.70 | 0.66% |
| LF | BONDESF | 250724 | mxAAA | 25,005,140.25 | 0.55% |
| LF | BONDESF | 251002 | mxAAA | 50,554,880.07 | 1.11% |
| LF | BONDESF | 251023 | mxAAA | 50,313,489.00 | 1.11% |
| LF | BONDESF | 260604 | mxAAA | 100,523,549.00 | 2.22% |
| LF | BONDESF | 261001 | mxAAA | 30,064,084.80 | 0.66% |
| LF | BONDESF | 270114 | mxAAA | 200,128,924.29 | 5.02% |
| LF | BONDESF | 270422 | mxAAA | 19,974,889.80 | 0.44% |
| LF | BONDESF | 271014 | mxAAA | 49,789,008.50 | 1.10% |
| LF | BONDESF | 280127 | mxAAA | 49,876,919.50 | 1.10% |
| LF | BONDESF | 290419 | mxAAA | 71,372,593.61 | 1.58% |
| LF | BONDESF | 291004 | mxAAA | 49,748,336.50 | 1.10% |
| LF | BONDESF | 320415 | mxAAA | 19,828,212.80 | 0.43% |
| | | | | 1,013,204,962.87 | |
| LG | BONDESG | 270506 | AAA(mex) | 100,345,688.00 | 2.22% |
| | | | | 100,345,688.00 | |
| | | | | 1,863,867,318.47 | |
| Bancarios | | | | | |
| 94 | BACOMER | 20-2 | AAA(mex) | 10,022,251.10 | 0.22% |
| 94 | BACTIN | 22 | AA(mex) | 25,125,508.00 | 0.55% |
| 94 | BLADEX | 21 | mxAAA | 30,029,481.60 | 0.66% |
| 94 | BLADEX | 22 | mxAAA | 30,105,416.10 | 0.66% |
| 94 | BMIFEL | 23V | AA+(mex) | 34,445,395.11 | 0.76% |
| 94 | COMPART | 22S | mxAA | 25,188,519.50 | 0.55% |
| 94 | COMPART | 24S | AA(mex) | 35,437,183.95 | 0.78% |
| | | | | 190,353,755.36 | |
| 94F | BSMX | 22-3 | AAA(mex) | 40,233,652.00 | 0.89% |
| | | | | 40,233,652.00 | |
| CD | BACMEXT | 21-2 | mxAAA | 15,100,570.65 | 0.33% |

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

¹ El riesgo por invertir en certificados bursátiles fiduciarios o valores respaldados por activos en caso de formar parte de la cartera de inversión del fondo radica en el impacto negativo de movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan directamente al subyacente de los instrumentos adquiridos. El riesgo asociado se considera alto debido a la existencia de riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipo de cambio, inflación entre otros, además de que la liquidez de los instrumentos puede verse afectada negativamente en caso de no existir un mercado secundario desarrollado para los mismos.

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 28/06/2024
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

| TIPO DE VALOR | EMISORA | SERIE | CALIFICACION / BURSATILIDAD | IMPORTE A MERCADO | % |
|----------------------|---------|--------|-----------------------------|-------------------|-------|
| Bancarios | | | | | |
| CD | BANOB | 20-2X | mxAAA | 10,086,926.90 | 0.22% |
| CD | NAFR | 260626 | mxAAA | 7,235,690.29 | 0.16% |
| CD | SHF | 21-2 | AAA(mex) | 10,038,535.90 | 0.22% |
| | | | | 42,461,723.74 | |
| CDF | BACMEXT | 24X | AAA(mex) | 30,279,636.00 | 0.67% |
| CDF | NAFR | 23-3S | mxAAA | 15,101,286.60 | 0.33% |
| CDF | SHF | 23 | AAA(mex) | 15,072,512.40 | 0.33% |
| | | | | 60,453,435.00 | |
| | | | | 333,502,566.10 | |
| Papel Privado | | | | | |
| 91 | AC | 24 | AAA(mex) | 20,107,053.60 | 0.44% |
| 91 | ACBE | 24L | mxAAA | 37,933,087.55 | 0.83% |
| 91 | AMX | 22 | mxAAA | 40,296,034.00 | 0.89% |
| 91 | AMX | 23-3 | mxAAA | 15,096,352.35 | 0.33% |
| 91 | ARA | 23X | mxAA- | 60,496,779.00 | 1.33% |
| 91 | BBPEN | 21 | AA+(mex) | 18,483,842.65 | 0.40% |
| 91 | BWMX | 21X | AA(mex) | 37,293,057.02 | 0.82% |
| 91 | BWMX | 23 | AA(mex) | 30,242,854.80 | 0.66% |
| 91 | CEMEX | 23L | mxAA+ | 47,813,358.24 | 1.05% |
| 91 | CIRCLEK | 22 | HR A+ | 16,167,370.20 | 0.35% |
| 91 | ELEKTRA | 22 | HR AA | 10,053,145.90 | 0.22% |
| 91 | ELEKTRA | 22-3 | HR AA | 15,104,212.20 | 0.33% |
| 91 | FERROMX | 21-2 | mxAAA | 23,492,545.68 | 0.52% |
| 91 | GAP | 20 | mxAAA | 43,051,979.69 | 0.95% |
| 91 | GAP | 21 | mxAAA | 25,108,923.75 | 0.55% |
| 91 | GAP | 22L | mxAAA | 30,274,545.30 | 0.67% |
| 91 | GAP | 23L | mxAAA | 20,085,897.80 | 0.44% |
| 91 | GAP | 24L | mxAAA | 20,121,240.40 | 0.44% |
| 91 | GASA | 24 | AA+.mx | 50,054,630.00 | 1.10% |
| 91 | GCARSO | 23 | AAA(mex) | 65,457,574.00 | 1.44% |

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

¹ El riesgo por invertir en certificados bursátiles fiduciarios o valores respaldados por activos en caso de formar parte de la cartera de inversión del fondo radica en el impacto negativo de movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan directamente al subyacente de los instrumentos adquiridos. El riesgo asociado se considera alto debido a la existencia de riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipo de cambio, inflación entre otros, además de que la liquidez de los instrumentos puede verse afectada negativamente en caso de no existir un mercado secundario desarrollado para los mismos.

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 28/06/2024
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

| TIPO DE VALOR | EMISORA | SERIE | CALIFICACION / BURSATILIDAD | IMPORTE A MERCADO | % |
|----------------------|---------|-------|-----------------------------|-------------------|-------|
| Papel Privado | | | | | |
| 91 | GCARSO | 24 | AAA(mex) | 50,095,486.00 | 1.10% |
| 91 | GHEMA | 23 | HR A- | 15,116,919.75 | 0.33% |
| 91 | GMFIN | 22 | mxAAA | 25,106,990.43 | 0.55% |
| 91 | GMFIN | 23 | mxAAA | 25,223,302.50 | 0.55% |
| 91 | GPH | 22 | AAA(mex) | 30,079,560.00 | 0.66% |
| 91 | GRUMA | 22 | mxAA+ | 40,162,388.40 | 0.88% |
| 91 | HERDEZ | 20-2 | mxAA | 10,031,955.80 | 0.22% |
| 91 | HERDEZ | 22-2L | mxAA | 28,545,687.21 | 0.63% |
| 91 | HYCSA | 24 | AA | 25,239,457.50 | 0.55% |
| 91 | INVEX | 22 | mxA+ | 60,445,438.20 | 1.33% |
| 91 | KOF | 20-2 | mxAAA | 72,057,808.08 | 1.59% |
| 91 | LAB | 23 | AA+(mex) | 50,098,921.50 | 1.10% |
| 91 | LAB | 23-2 | AA+(mex) | 50,188,849.00 | 1.11% |
| 91 | LALA | 19-2 | AA(mex) | 40,155,452.80 | 0.88% |
| 91 | MEGA | 22 | AAA(mex) | 35,189,575.75 | 0.77% |
| 91 | MEGA | 24X | AAA(mex) | 60,252,978.00 | 1.33% |
| 91 | MOLYMET | 23 | AAA(mex) | 60,240,522.00 | 1.33% |
| 91 | MONTPIO | 21 | HR AA+ | 40,142,263.20 | 0.88% |
| 91 | MONTPIO | 23 | HR AA+ | 30,043,688.10 | 0.66% |
| 91 | NAVISTS | 22 | mxAA+ | 28,000,229.88 | 0.61% |
| 91 | NAVISTS | 24 | AAA(mex) | 40,316,349.60 | 0.89% |
| 91 | NM | 24 | mxAA+ | 60,294,588.60 | 1.33% |
| 91 | OMA | 21V | AAA(mex) | 15,253,600.95 | 0.33% |
| 91 | OMA | 23L | AAA(mex) | 30,028,395.90 | 0.66% |
| 91 | ORBIA | 22L | AAA(mex) | 70,275,998.80 | 1.55% |
| 91 | SIGMA | 24 | AAA(mex) | 75,624,295.50 | 1.67% |
| 91 | SORIANA | 23 | AAA(mex) | 50,437,694.50 | 1.11% |
| 91 | TIPMXCB | 23-2 | AAA(mex) | 30,370,806.00 | 0.67% |
| 91 | TOYOTA | 21 | mxAAA | 11,567,906.36 | 0.25% |
| 91 | TOYOTA | 23 | mxAAA | 12,583,930.29 | 0.27% |

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

¹ El riesgo por invertir en certificados bursátiles fiduciarios o valores respaldados por activos en caso de formar parte de la cartera de inversión del fondo radica en el impacto negativo de movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan directamente al subyacente de los instrumentos adquiridos. El riesgo asociado se considera alto debido a la existencia de riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipo de cambio, inflación entre otros, además de que la liquidez de los instrumentos puede verse afectada negativamente en caso de no existir un mercado secundario desarrollado para los mismos.

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 28/06/2024
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

| TIPO DE VALOR | EMISORA | SERIE | CALIFICACION / BURSATILIDAD | IMPORTE A MERCADO | % |
|----------------------|---------|--------|-----------------------------|-------------------|-------|
| Papel Privado | | | | | |
| 91 | VWLEASE | 22-2 | mxAAA | 30,081,534.30 | 0.66% |
| 91 | VWLEASE | 24 | mxAAA | 40,403,571.60 | 0.89% |
| | | | | 1,870,390,630.63 | |
| 91 ¹ | ATLASCB | 22 | HR AAA | 30,066,094.20 | 0.66% |
| 91 ¹ | FUTILCB | 21 | mxAAA | 30,280,295.40 | 0.67% |
| 91 ¹ | INVTACB | 23 | AA-.mx | 25,332,933.50 | 0.56% |
| 91 ¹ | VOLARCB | 21L | HR AA+ | 11,267,185.83 | 0.24% |
| 91 ¹ | VOLARCB | 23 | HR AA+ | 30,122,246.40 | 0.66% |
| | | | | 127,068,755.33 | |
| 93 | ARREACT | 00124 | F1+(mex) | 16,772,764.93 | 0.37% |
| 93 | ARREACT | 00624 | F1+(mex) | 15,056,025.90 | 0.33% |
| 93 | ARREACT | 01224 | F1+(mex) | 15,056,059.35 | 0.33% |
| 93 | RUBA | 00224 | mxA-1+ | 15,121,302.30 | 0.33% |
| | | | | 62,006,152.48 | |
| 93B | AMX | 07924 | mxA-1+ | 17,278,407.09 | 0.38% |
| 93B | AMX | 08324 | mxA-1+ | 14,664,660.45 | 0.32% |
| | | | | 31,943,067.54 | |
| 94 | BLADEX | 24 | mxAAA | 30,193,949.40 | 0.66% |
| | | | | 30,193,949.40 | |
| D2P | GS861 | 240905 | BBB+ | 25,152,455.76 | 0.55% |
| D2P | JPM918 | 240703 | A- | 40,350,738.00 | 0.89% |
| | | | | 65,503,193.76 | |
| | | | | 2,187,105,749.14 | |

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

¹ El riesgo por invertir en certificados bursátiles fiduciarios o valores respaldados por activos en caso de formar parte de la cartera de inversión del fondo radica en el impacto negativo de movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan directamente al subyacente de los instrumentos adquiridos. El riesgo asociado se considera alto debido a la existencia de riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipo de cambio, inflación entre otros, además de que la liquidez de los instrumentos puede verse afectada negativamente en caso de no existir un mercado secundario desarrollado para los mismos.

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 28/06/2024
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

| TIPO DE VALOR | EMISORA | SERIE | CALIFICACION / BURSATILIDAD | IMPORTE A MERCADO | % |
|--------------------------------|---------|--------|-----------------------------|-------------------------|----------------|
| Reportos | | | | | |
| IQ | BPAG91 | 280106 | mxAAA | 132,401,170.39 | 2.93% |
| | | | | <u>132,401,170.39</u> | |
| | | | | <u>132,401,170.39</u> | |
| CARTERA TOTAL: | | | | 4,516,876,804.10 | 100.00% |
| VaR ESTABLECIDO: | | | 0.250 % | | |
| VaR OBSERVADO PROMEDIO: | | | 0.0040 % | | |

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

¹ El riesgo por invertir en certificados bursátiles fiduciarios o valores respaldados por activos en caso de formar parte de la cartera de inversión del fondo radica en el impacto negativo de movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan directamente al subyacente de los instrumentos adquiridos. El riesgo asociado se considera alto debido a la existencia de riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipo de cambio, inflación entre otros, además de que la liquidez de los instrumentos puede verse afectada negativamente en caso de no existir un mercado secundario desarrollado para los mismos.