

**FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
DISCRECIONAL**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL					
MP	BONOS	270304	HR AA+	18,669,925	5.33%
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS					
94				10,277,145	2.93%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				34,112,732	9.73%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	240725	HR1	70,971,405	20.25%
BI	CETES	241128	HR1	54,783,882	15.63%
BI	CETES	241003	HR1	20,773,478	5.93%
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC					
D8	CIT1125	FLOAT	A	10,178,590	2.90%
				219,767,157	62.72%
REPORTO					
LF	BONDESF	261231	mxAAA	62,790,158	17.92%
LF	BONDESF	270930	mxAAA	62,790,076	17.92%
				125,580,234	35.84%
OTROS VALORES					
				5,069,696	1.45%
				5,069,696	1.45%
	TOTAL CARTERA			350,417,088	100.00%
	ACTIVO NETO			350,098,386	
	VAR ESTABLECIDO \$			5,256,256	1.50%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			321,937	0.10%
	Cartera al:		25-Jan-24		

Para determinar el valor máximo de VaR de mercado, se considera la totalidad de la composición de la cartera y se estresa en los máximos permitidos, utilizando la metodología histórica donde se calcula el vigésimo quinto escenario con mayor exposición al riesgo tomando como base un periodo de muestra de 500 días anteriores (que representan el percentil 5 de la serie). El límite autorizado del VaR de la cartera de inversión respecto de sus activos netos es del 1.5% con una probabilidad del 95%