

**FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA					
M	BONOS	310529	mxAAA	1,784,540,497	40.27%
M	BONOS	290531	mxAAA	1,062,509,043	23.98%
M	BONOS	270603	mxAAA	418,950,742	9.45%
M	BONOS	330526	mxAAA	90,087,267	2.03%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL					
MP	BONOS	270304	HR AA+	124,465,792	2.81%
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS					
94				104,827,562	2.37%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				535,384,065	12.08%
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC					
D8				121,688,681	2.75%
				4,242,453,649	95.73%
REPORTO					
LF	BONDESF	261231	mxAAA	124,401,242	2.81%
				124,401,242	2.81%
OTROS VALORES					
				64,685,459	1.46%
				64,685,459	1.46%
	TOTAL CARTERA			4,431,540,350	100.00%
	ACTIVO NETO			4,428,117,366	
	VAR ESTABLECIDO \$			44,298,139	1.00%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			8,780,424	0.20%
	Cartera al:		25-Jan-24		

Para calcular el límite máximo de VaR, se considera la totalidad de la composición de la cartera. El límite autorizado de VaR de la cartera de inversión respecto de sus activos netos es del 1.20% con una probabilidad del 95%.