

**FONDO DE INVERSION DE RENTA VARIABLE  
ESPECIALIZADAS EN DEUDA**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>DIRECTO</b>					
<b>BONOS DEL GOBIERNO FEDERAL COLOCADOS EN EL EXTERIOR UMS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>					
D1SP	MEXG29	260121	BBB-	66,479,902	14.50%
D1SP	MEXC46	270328	BBB-	55,090,723	12.01%
D1SP	MEXE02	280111	BBB-	32,995,752	7.19%
D1SP	MEXJ98	250427	BBB-	22,566,915	4.92%
<b>CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES</b>					
CHD	BACMEXT	5193582		40,199,096	8.77%
<b>TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>					
1ISP	VGSH	*	ALTA	79,229,985	17.28%
1ISP	SHY	*	ALTA	73,611,251	16.05%
1ISP	VGIT	*	ALTA	39,994,290	8.72%
1ISP	IEI	*	ALTA	32,371,860	7.06%
				<b>442,539,774</b>	<b>96.49%</b>
<b>OTROS VALORES</b>				16,084,485	3.51%
				<b>16,084,485</b>	<b>3.51%</b>
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>458,624,259</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>458,853,449</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>				<b>9,776,167</b>	<b>2.13%</b>
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>				<b>1,648,264</b>	<b>0.36%</b>
<b>Cartera al:</b>			<b>25-Jan-24</b>		

Para calcular el límite máximo de VaR, se considera la totalidad de la composición de la cartera. El límite superior o Valor en Riesgo máximo que se presenta en el régimen de inversión se obtiene calculando el quinto peor escenario con base en la metodología histórica, y asumiendo una composición de cartera en los máximos permitidos.

Direcciones electrónicas para consultar la Tenencia de Activos Objeto de Inversión:

IEI \*  
VGSH \*

<http://www.bloomberg.com/quote/SHY:US>  
<http://www.bloomberg.com/quote/VGSH:US>