

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

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>DIRECTO</b>					
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL</b>					
MP	BONOS	270304	HR AA+	20,179,068	4.02%
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>					
91	ENGENCB	24	AAA.mx	13,041,326	2.60%
91	MOLYMET	24	AAA(mex)	10,061,105	2.01%
91				27,188,404	5.42%
<b>CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO</b>					
BI	CETES	261001	HR1	210,344,850	41.93%
BI	CETES	250220	HR1	97,787,820	19.49%
BI	CETES	260219	HR1	17,775,856	3.54%
<b>TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC</b>					
D8	CIT1125	FLOAT	A	10,132,249	2.02%
				<b>406,510,678</b>	<b>81.03%</b>
<b>REPORTO</b>					
LF	BONDESF	261231	mxAAA	40,661,612	8.11%
IQ	BPAG91	270909	mxAAA	40,661,282	8.11%
				<b>81,322,894</b>	<b>16.21%</b>
<b>OTROS VALORES</b>					
				13,848,259	2.76%
				<b>13,848,259</b>	<b>2.76%</b>
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>501,681,830</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>501,247,608</b>	
	<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>			<b>7,529,133</b>	<b>1.50%</b>
	<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>			<b>824,767</b>	<b>.21%</b>
	<b>Cartera al:</b>		<b>29-Nov-24</b>		

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%