

**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+	20,180,645	4.01%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91	ENGENCB	24	AAA.mx	13,123,144	2.60%
91				37,039,363	7.35%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	261001	HR1	211,505,925	41.98%
BI	CETES	250220	HR1	98,301,110	19.51%
BI	CETES	260219	HR1	17,897,960	3.55%
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC					
D8	CIT1125	FLOAT	A	10,093,788	2.00%
				408,141,935	81.01%
REPORTO					
LF	BONDEF	261231	mxAAA	40,351,823	8.01%
IM	BPAG28	270506	mxAAA	20,933,279	4.16%
IM	BPAG28	261105	mxAAA	19,418,460	3.85%
				80,703,562	16.02%
OTROS VALORES					
				14,964,554	2.97%
				14,964,554	2.97%
	TOTAL CARTERA			503,810,050	100.00%
	ACTIVO NETO			503,404,067	
	VAR ESTABLECIDO \$			7,557,141	1.50%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			411,069	0.00%
	Cartera al:		19-Dec-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%