

**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					
M	BONOS	290531	mxAAA	49,858,720	12.57%
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA SEGREGABLES PRINCIPAL					
MP	BONOS	270304	HR AA+	18,984,958	4.79%
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS					
94				10,175,985	2.57%
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS					
91				34,091,695	8.60%
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO					
F	BACOMER	24359	mxA-1+	9,889,978	2.49%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	240725	HR1	72,420,525	18.26%
BI	CETES	241128	HR1	55,853,370	14.08%
BI	CETES	241003	HR1	21,183,494	5.34%
BI	CETES	260219	HR1	16,566,246	4.18%
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC					
D8	CIT1125	FLOAT	A	10,204,195	2.57%
				299,229,167	75.46%
REPORTO					
LF	BONDESF	270318	mxAAA	41,543,649	10.48%
IM	BPAG28	261105	mxAAA	41,543,563	10.48%
				83,087,212	20.95%
OTROS VALORES					
				14,243,163	3.59%
				14,243,163	3.59%
	TOTAL CARTERA			396,559,542	100.00%
	ACTIVO NETO			396,117,363	
	VAR ESTABLECIDO \$			5,948,393	1.50%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			850,381	.24%
	Cartera al:		27-Mar-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%