



INVESTMENT MANAGEMENT

FONDEO

AAA/1 MO

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CORTO PLAZO

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF / BURS | VALOR TOTAL | % |
|--|----------------------------------|--------|------------------|-----------------------|----------------|
| DIRECTO | | | | | |
| BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F | | | | | |
| LF | BONDES F | 250327 | mxAAA | 604,195,392 | 3.47% |
| | | | | 604,195,392 | 3.47% |
| REPORTO | | | | | |
| IM | BPAG28 | 270805 | mxAAA | 3,305,210,900 | 18.99% |
| IQ | BPAG91 | 250904 | mxAAA | 2,023,432,493 | 11.63% |
| LF | BONDES F | 261231 | mxAAA | 2,015,218,716 | 11.58% |
| LF | BONDES F | 270318 | mxAAA | 1,614,686,819 | 9.28% |
| LF | BONDES F | 250130 | mxAAA | 1,510,377,380 | 8.68% |
| IS | BPA182 | 300328 | mxAAA | 1,465,122,947 | 8.42% |
| LF | BONDES F | 260226 | mxAAA | 1,258,313,875 | 7.23% |
| LF | BONDES F | 261231 | mxAAA | 914,639,070 | 5.25% |
| M | BONOS | 290301 | mxAAA | 530,023,119 | 3.05% |
| BI | CETES | 261001 | HR1 | 500,441,660 | 2.88% |
| M | BONOS | 260305 | mxAAA | 413,606,291 | 2.38% |
| IQ | BPAG91 | 270909 | mxAAA | 389,996,278 | 2.24% |
| IM | BPAG28 | 270506 | mxAAA | 358,698,531 | 2.06% |
| | | | | 16,299,768,080 | 93.65% |
| OTROS VALORES | | | | 501,245,265 | 2.88% |
| | | | | 501,245,265 | 2.88% |
| | TOTAL CARTERA | | | 17,405,208,737 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 17,386,336,687 | |
| | VAR ESTABLECIDO \$ | | | 1,740,521 | .01% |
| | VAR OBSERVADO PROMEDIO \$ | | | 1,802 | .00% |
| | Cartera al: | | 29-Nov-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 VaR de la cartera de inversión respecto de sus activos netos es del 0.01% con una probabilidad del 95%.