

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
 MEDIANO PLAZO

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF / BURS | VALOR TOTAL | % |
|--|----------------------------------|--------|------------------|--------------------|----------------|
| DIRECTO | | | | | |
| CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS | | | | | |
| 94 | BANORTE | 19-2 | mxAAA | 20,128,325 | 4.18% |
| 94 | BSANT | 16-3 | AAA.mx | 13,255,686 | 2.75% |
| 94 | BINBUR | 14-7 | mxAAA | 12,016,543 | 2.50% |
| 94 | BBVAMX | 23 | mxAAA | 11,998,246 | 2.49% |
| 94 | BSMX | 21 | AAA.mx | 10,050,161 | 2.09% |
| 94 | | | | 9,808,831 | 2.04% |
| CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO | | | | | |
| CD | NAFF | 23S | mxAAA | 9,820,519 | 2.04% |
| CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO | | | | | |
| 93 | | | | 13,308,907 | 2.77% |
| CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS | | | | | |
| 91 | FERROMX | 14 | mxAAA | 19,856,036 | 4.13% |
| 91 | MOLYMET | 23-2 | AAA(mex) | 14,727,813 | 3.06% |
| 91 | GAP | 20 | mxAAA | 14,123,322 | 2.93% |
| 91 | ENCAPCB | 21 | AAA(mex) | 14,013,651 | 2.91% |
| 91 | LALA | 19 | AA(mex) | 13,464,468 | 2.80% |
| 91 | OMA | 21V | AAA.mx | 11,180,002 | 2.32% |
| 91 | GPH | 22 | AAA(mex) | 10,354,810 | 2.15% |
| 91 | GCARSO | 23 | AAA(mex) | 10,048,784 | 2.09% |
| 91 | ALSEA | 19-2 | A+(mex) | 10,040,808 | 2.09% |
| 91 | GRUMA | 22 | mxAA+ | 10,028,130 | 2.08% |
| 91 | FEMSA | 22L | mxAAA | 10,006,350 | 2.08% |
| 91 | | | | 131,973,252 | 27.42% |
| CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL | | | | | |
| 95 | FEFA | 23 | mxAAA | 10,021,926 | 2.08% |
| TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC | | | | | |
| D8 | CIT1125 | FLOAT | A | 10,207,814 | 2.12% |
| | | | | 390,434,385 | 81.13% |
| REPORTO | | | | | |
| LF | BONDESF | 261231 | mxAAA | 68,730,154 | 14.28% |
| | | | | 68,730,154 | 14.28% |
| OTROS VALORES | | | | | |
| | | | | 22,071,795 | 4.59% |
| | | | | 22,071,795 | 4.59% |
| | TOTAL CARTERA | | | 481,236,334 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 480,941,334 | |
| | VAR ESTABLECIDO \$ | | | 2,406,929 | .50% |
| | VAR OBSERVADO PROMEDIO \$ | | | 557,968 | .11% |
| | Cartera al: | | 30-Apr-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).