

**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	601,235,250	3.79%
				601,235,250	3.79%
REPORTO					
LF	BONDES F	270930	mxAAA	3,096,534,243	19.52%
IQ	BPAG91	290510	mxAAA	2,026,568,519	12.78%
IS	BPA182	270121	mxAAA	2,013,793,377	12.69%
LF	BONDES F	250424	mxAAA	1,462,766,940	9.22%
LF	BONDES F	310320	mxAAA	979,585,685	6.18%
M	BONOS	530731	mxAAA	926,504,863	5.84%
IQ	BPAG91	270506	mxAAA	816,087,124	5.14%
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	717,252,427	4.52%
BI	CETES	251030	HR1	596,266,775	3.76%
IQ	BPAG91	270107	mxAAA	595,105,608	3.75%
BI	CETES	250918	HR1	508,932,306	3.21%
LF	BONDES F	291004	mxAAA	466,834,120	2.94%
BI	CETES	260611	HR1	460,305,300	2.90%
M	BONOS	290301	mxAAA	395,217,865	2.49%
				15,061,755,153	94.95%
OTROS VALORES					
				200,064,568	1.26%
				200,064,568	1.26%
TOTAL CARTERA				15,863,054,971	100.00%
ACTIVO NETO				15,837,633,669	
VAR ESTABLECIDO \$				1,586,305	0.01%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				356	0.00%
Cartera al:			11-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 VaR de la cartera de inversión respecto de sus activos netos es del 0.01% con una probabilidad del 95%.