

**FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
MEDIANO PLAZO**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>DIRECTO</b>					
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS</b>					
94	BANORTE	19-2	mxAAA	20,091,375	3.98%
94	BSANT	16-3	AAA.mx	13,232,748	2.62%
94	BINBUR	14-7	mxAAA	11,992,299	2.37%
94	BBVAMX	23	mxAAA	11,991,679	2.37%
94				19,830,294	3.92%
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO</b>					
93				13,283,218	2.63%
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>					
91	FERROMX	14	mxAAA	19,814,378	3.92%
91	MOLYMET	23-2	AAA(mex)	15,550,436	3.08%
91	GAP	20	mxAAA	14,096,574	2.79%
91	ENCAPCB	21	AAA(mex)	13,982,869	2.77%
91	LALA	19	AA(mex)	13,438,931	2.66%
91	OMA	21V	AAA.mx	11,158,774	2.21%
91	GPH	22	AAA(mex)	10,427,398	2.06%
91				171,956,177	34.04%
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL</b>					
95				19,577,222	3.87%
<b>TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC</b>					
D8	CIT1125	FLOAT	A	10,187,421	2.02%
				<b>390,611,793</b>	<b>77.31%</b>
<b>REPORTO</b>					
LF	BONDEF	260226	mxAAA	92,260,451	18.26%
				<b>92,260,451</b>	<b>18.26%</b>
<b>OTROS VALORES</b>					
				<b>22,357,439</b>	<b>4.43%</b>
				<b>22,357,439</b>	<b>4.43%</b>
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>505,229,684</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>504,976,369</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>				<b>2,526,653</b>	<b>0.50%</b>
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>				<b>277,296</b>	<b>0.05%</b>
<b>Cartera al:</b>			<b>25-Apr-24</b>		
<p>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).</p>					