

**FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL**

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
DIRECTO					
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F					
LF	BONDES F	241107	mxAAA	300,687,420	3.11%
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO					
BI	CETES	250206	HR1	2,294,867,950	23.72%
BI	CETES	241128	HR1	1,107,603,287	11.45%
BI	CETES	250821	HR1	1,106,613,865	11.44%
BI	CETES	250220	HR1	1,089,918,248	11.27%
BI	CETES	250724	HR1	633,043,730	6.54%
BI	CETES	250123	HR1	632,988,242	6.54%
BI	CETES	250918	HR1	570,069,549	5.89%
BI	CETES	241024	HR1	480,190,498	4.96%
BI	CETES	250320	HR1	408,672,086	4.22%
BI	CETES	250403	HR1	284,015,820	2.94%
BI				321,688,912	3.32%
				9,230,359,606	95.40%
REPORTO					
LF	BONDES F	291004	mxAAA	259,411,200	2.68%
				259,411,200	2.68%
OTROS VALORES					
				185,323,680	1.92%
				185,323,680	1.92%
	TOTAL CARTERA			9,675,094,485	100.00%
	ACTIVO NETO			9,669,895,189	
	VAR ESTABLECIDO \$			6,772,566	0.07%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			920,200	0.01%
	Cartera al:		19-Sep-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. El VaR de la cartera de inversión respecto de sus activos netos es del 0.07% con una probabilidad del 95%