

**FONDO DE INVERSION DE RENTA VARIABLE
ESPECIALIZADAS EN DEUDA**

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF / BURS | VALOR TOTAL | % |
|--|----------------------------------|---------|------------------|--------------------|----------------|
| DISPONIBILIDADES | | | | | |
| DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN | | | | | |
| CHD | BACMEXT | 5193582 | | 24,907,640 | 3.67% |
| | | | | 24,907,640 | 3.67% |
| TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | |
| INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO | | | | | |
| EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS | | | | | |
| 1ISP | IEI | * | ALTA | 91,468,375 | 13.46% |
| 1ISP | SHY | * | ALTA | 133,395,608 | 19.64% |
| 1ISP | VDST | N | ALTA | 37,952,976 | 5.59% |
| 1ISP | VGIT | * | ALTA | 39,408,293 | 5.80% |
| 1ISP | VGSH | * | ALTA | 128,292,475 | 18.88% |
| 1ISP | VT | * | ALTA | 7,230,330 | 1.06% |
| | | | | 437,748,057 | 64.44% |
| INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | |
| VALORES GUBERNAMENTALES | | | | | |
| D1SP | MEXC46 | 270328 | BBB- | 96,273,713 | 14.17% |
| D1SP | MEXG29 | 260121 | BBB- | 75,720,555 | 11.15% |
| D1SP | MEXJ98 | 250427 | BBB- | 25,458,094 | 3.75% |
| | | | | 197,452,362 | 29.07% |
| TÍTULOS BANCARIOS | | | | | |
| 94SP | BACOMER | 20D | AAA.mx | 9,835,866 | 1.45% |
| | | | | 9,835,866 | 1.45% |
| PAPEL PRIVADO | | | | | |
| 91SP | FMTY | 20D | AA(mex) | 3,800,474 | 0.56% |
| | | | | 3,800,474 | 0.56% |
| OPERACIONES DE REPORTO | | | | | |
| REPORTADOR | | | | | |
| LF | BONDESF | 250619 | mxAAA | 5,598,038 | 0.82% |
| | | | | 5,598,038 | 0.82% |
| | TOTAL CARTERA | | | 679,342,437 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 679,140,442 | |
| | VAR ESTABLECIDO \$ | | | 14,470,176 | 2.13% |
| | VAR OBSERVADO PROMEDIO \$ | | | 6,420,395 | .94% |
| | Cartera al: | | 30-Dec-22 | | |
| <p>Para calcular el límite máximo de VaR, se considera la totalidad de la composición de la cartera. El límite superior o Valor en Riesgo máximo que se presenta en el régimen de inversión se obtiene calculando el quinto peor escenario con base en la metodología histórica, y asumiendo una composición de cartera en los máximos permitidos.</p> | | | | | |

Direcciones electrónicas para consultar la Tenencia de Activos Objeto de Inversión:

 IEI *
 VGSH *

<http://www.bloomberg.com/quote/SHY:US>
<http://www.bloomberg.com/quote/VGSH:US>