

FONDO DE INVERSION DE RENTA VARIABLE  
 ESPECIALIZADAS EN DEUDA

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>DIRECTO</b>					
<b>BONOS DEL GOBIERNO FEDERAL COLOCADOS EN EL EXTERIOR UMS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>					
D1SP	MEXG29	260121	BBB-	65,748,442	18.87%
D1SP	MEXC46	270328	BBB-	52,896,351	15.18%
D1SP	MEXE02	280111	BBB-	32,520,915	9.33%
<b>CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES</b>					
CHD	BACMEXT	5193582		28,554,226	8.19%
<b>TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>					
1ISP	VCSH	*	ALTA	39,296,746	11.28%
1ISP	VGIT	*	ALTA	38,668,947	11.10%
1ISP	VGSH	*	ALTA	33,011,186	9.47%
1ISP	IEI	*	ALTA	26,443,374	7.59%
1ISP	SHY	*	ALTA	22,669,965	6.51%
				<b>339,810,152</b>	<b>97.51%</b>
<b>OTROS VALORES</b>				<b>8,682,399</b>	<b>2.49%</b>
				<b>8,682,399</b>	<b>2.49%</b>
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>348,492,551</b>	<b>100.00%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>348,336,857</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>				<b>7,422,934</b>	<b>2.13%</b>
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>				<b>2,915,009</b>	<b>.84%</b>
<b>Cartera al:</b>			<b>31-May-24</b>		
<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 \*

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

VGSH \*

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