

FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
LARGO PLAZO TASA REAL

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
VALORES GUBERNAMENTALES					
S	UDIBONO	281130	NO APLICA	2,786,363	83.462%
S	UDIBONO	401115	NO APLICA	55,973	1.677%
S	UDIBONO	251204	NO APLICA	28,234	0.846%
S	UDIBONO	501103	NO APLICA	19,265	0.577%
				2,889,835	86.561%
VALORES PRIVADOS					
90	PAMMCB	14U	mxAAA	25,660	0.769%
91	CAMSCB	13U	AA+ (mex)	23,176	0.694%
91	MAYACB	12U	Baa2	20,170	0.604%
91	RCO	12U	mxAAA	8,327	0.249%
91	TENIXCB	14U	AA+ (mex)	7,612	0.228%
91	OPI	15U	mxA	4,465	0.134%
94	BINTER	16U	AAA (mex)	16,640	0.498%
95	FOVISCB	18U	Baa1	37,618	1.127%
95	FHIPOCB	17U	AAA (mex)	28,624	0.857%
95	CFE	15U	Baa1	18,968	0.568%
95	FOVISCB	17-2U	Baa1	13,169	0.394%
97	MTROFCB	08	mxAA	569	0.017%
2U	CBIC006	321125	NO APLICA	34,767	1.041%
2U	CBIC009	331124	NO APLICA	24,992	0.749%
D2	CONM151	351215	BBB	65,997	1.977%
D7	BAC871	251021	A	61,149	1.832%
D8	BARCLAY	5-07	A	9,093	0.272%
				400,996	12.011%
Reportos					
LD	BONDESD	220113	NO APLICA	47,652	1.427%
				47,652	1.427%
TOTAL CARTERA				3,338,483	100.000%
ACTIVO NETO				3,298,229	
VAR ESTABLECIDO \$				104,884	3.180%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				8,333	0.246%
Cartera al:				29-ene.-21	

Metodo Historico, 1 dia con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.