

## FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

## LARGO PLAZO TASA REAL

(Cifras en miles de pesos)

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>					
S	UDIBONO	281130	mxAAA	2,445,332	81.194%
S	UDIBONO	501103	mxAAA	1	0.000%
				<b>2,445,333</b>	<b>81.194%</b>
<b>VALORES PRIVADOS</b>					
90	PAMMCB	14U	mxAAA	22,269	0.739%
91	CAMSCB	13U	AA+ (mex)	22,425	0.745%
91	MAYACB	12U	Baa2	18,400	0.611%
91	RCO	12U	mxAAA	7,512	0.249%
91	TENIXCB	14U	AA+ (mex)	6,794	0.226%
91	OPI	15U	mxA	4,056	0.135%
94	BINTER	16U	AAA (mex)	16,366	0.543%
95	FOVISCB	18U	Baa1	34,437	1.143%
95	FHIPOCB	17U	AAA (mex)	25,297	0.840%
95	CFE	15U	Baa1	19,314	0.641%
95	FOVISCB	17-2U	Baa1	12,080	0.401%
97	MTROFCB	08	mxAA	486	0.016%
2U	CBIC004	310116	mxAAA	180,774	6.002%
2U	CBIC006	321125	mxAAA	33,092	1.099%
2U	CBIC009	331124	mxAAA	23,643	0.785%
D2	CONM151	351215	BBB	61,329	2.036%
D7	BAC871	251021	A	61,408	2.039%
D8	BARCLAY	5-07	A	9,346	0.310%
				<b>559,028</b>	<b>18.562%</b>
<b>Reportos</b>					
LD	BONDESD	240822	mxAAA	7,363	0.244%
				<b>7,363</b>	<b>0.244%</b>
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>3,011,724</b>	<b>100.000%</b>
<b>ACTIVO NETO</b>				<b>3,073,768</b>	
<b>VAR ESTABLECIDO \$</b>				<b>97,746</b>	<b>3.180%</b>
<b>VAR OBSERVADO PROMEDIO \$</b>				<b>16,336</b>	<b>0.526%</b>
<b>Cartera al:</b>			<b>30-sep.-21</b>		

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