

BNPP-CP BNPP 1, S.A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda
CARTERA DE VALORES AL 09 ENERO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	250403	mxAAA	5,000,000	500,045,400.00	26.39
LF	BONDES F	250130	mxAAA	2,000,000	200,436,650.00	10.58
LF	BONDES F	270114	mxAAA	1,500,000	150,449,370.00	7.94
LF	BONDES F	250724	mxAAA	1,000,000	99,982,215.00	5.28
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	260611	HR1	6,000,000	52,406,160.00	2.77
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,003,319,795.00	52.95
REPORTO						
LF	BONDES F	291101	mxAAA	8,696,638	863,832,150.27	45.59
TOTAL REPORTO					863,832,150.27	45.59
OTROS VALORES				275,599	27,737,614.78	1.46
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,894,889,560.05	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAA/1CP

VaR Promedio
0.009%

Límite de VaR
0.001%

El valor en Riesgo se estima utilizando la metodología de Simulación Histórica de 500 escenarios con un nivel de confianza del 95% a dos colas. El Var Establecido es a un horizonte de 1 día.

Maria Cecilia Jiménez Cornejo