

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 18/07/2024
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
95	CFE	21-3	mxAAA	29,855,353.52	0.63%
95	CFE	21-4	mxAAA	30,207,707.40	0.64%
95	FNCOT	23S	AAA(mex)	60,144,783.60	1.28%
95	FNCOT	24	AAA(mex)	40,099,692.40	0.85%
				160,307,536.92	
BI	CETES	240725	mxA-1+	69,870,332.00	1.49%
				69,870,332.00	
IM	BPAG28	270204	mxAAA	100,286,714.00	2.14%
				100,286,714.00	
IQ	BPAG91	240829	mxAAA	25,384,446.25	0.54%
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	76,519,746.00	1.63%
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	40,437,197.20	0.86%
IQ	BPAG91	290111	mxAAA	99,470,712.00	2.12%
IQ	BPAG91	290510	mxAAA	50,658,646.00	1.08%
				292,470,747.45	
IS	BPA182	280412	mxAAA	25,609,362.50	0.54%
IS	BPA182	290322	mxAAA	31,518,159.90	0.67%
IS	BPA182	300328	mxAAA	30,773,025.30	0.65%
				87,900,547.70	
LD	BONDES	260611	mxAAA	19,993,965.40	0.42%
				19,993,965.40	
LF	BONDES	240725	mxAAA	25,168,505.00	0.53%
LF	BONDES	241003	mxAAA	40,091,622.00	0.85%
LF	BONDES	241024	mxAAA	50,219,452.50	1.07%
LF	BONDES	241107	mxAAA	50,003,865.00	1.06%
LF	BONDES	250227	mxAAA	19,997,215.20	0.42%
LF	BONDES	250327	mxAAA	29,994,413.10	0.64%
LF	BONDES	250403	mxAAA	50,309,066.00	1.07%
LF	BONDES	250424	mxAAA	29,991,271.50	0.64%

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

¹ El riesgo por invertir en certificados bursátiles fiduciarios o valores respaldados por activos en caso de formar parte de la cartera de inversión del fondo radica en el impacto negativo de movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan directamente al subyacente de los instrumentos adquiridos. El riesgo asociado se considera alto debido a la existencia de riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipo de cambio, inflación entre otros, además de que la liquidez de los instrumentos puede verse afectada negativamente en caso de no existir un mercado secundario desarrollado para los mismos.

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 18/07/2024
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
LF	BONDESF	250724	mxAAA	25,146,140.25	0.53%
LF	BONDESF	251002	mxAAA	50,402,823.97	1.07%
LF	BONDESF	251023	mxAAA	50,162,170.00	1.07%
LF	BONDESF	260604	mxAAA	100,221,586.00	2.14%
LF	BONDESF	261001	mxAAA	29,972,185.50	0.64%
LF	BONDESF	270114	mxAAA	199,501,814.18	4.26%
LF	BONDESF	270422	mxAAA	19,912,071.40	0.42%
LF	BONDESF	270520	mxAAA	49,767,498.00	1.06%
LF	BONDESF	271014	mxAAA	50,068,664.50	1.06%
LF	BONDESF	280127	mxAAA	49,725,391.00	1.06%
LF	BONDESF	290419	mxAAA	71,129,806.26	1.51%
LF	BONDESF	291004	mxAAA	49,576,880.50	1.05%
LF	BONDESF	320415	mxAAA	19,767,705.20	0.42%
				1,061,130,147.06	
LG	BONDESG	270506	AAA(mex)	100,044,267.00	2.13%
				100,044,267.00	
				1,892,004,257.53	

Bancarios

94	BACOMER	20-2	AAA(mex)	10,078,710.30	0.21%
94	BACTIN	22	AA(mex)	25,042,235.00	0.53%
94	BLADEX	21	mxAAA	30,200,744.10	0.64%
94	BLADEX	22	mxAAA	30,009,761.40	0.64%
94	BMIFEL	23V	AA+(mex)	34,651,960.75	0.74%
94	COMPART	22S	mxAA	25,243,966.00	0.53%
94	COMPART	24S	AA(mex)	35,172,798.50	0.75%
				190,400,176.05	
94F	BSMX	22-3	AAA(mex)	40,100,498.40	0.85%
				40,100,498.40	
CD	BACMEXT	21-2	mxAAA	15,053,752.20	0.32%

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

¹ El riesgo por invertir en certificados bursátiles fiduciarios o valores respaldados por activos en caso de formar parte de la cartera de inversión del fondo radica en el impacto negativo de movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan directamente al subyacente de los instrumentos adquiridos. El riesgo asociado se considera alto debido a la existencia de riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipo de cambio, inflación entre otros, además de que la liquidez de los instrumentos puede verse afectada negativamente en caso de no existir un mercado secundario desarrollado para los mismos.

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 18/07/2024
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Bancarios					
CD	BANOB	20-2X	mxAAA	10,055,147.00	0.21%
CD	NAFR	260626	mxAAA	7,274,531.95	0.15%
CD	SHF	21-2	AAA(mex)	10,094,687.10	0.21%
				42,478,118.25	
CDF	BACMEXT	24X	AAA(mex)	30,169,359.00	0.64%
CDF	NAFR	23-3S	mxAAA	15,054,282.15	0.32%
CDF	SHF	23	AAA(mex)	15,025,494.75	0.32%
				60,249,135.90	
				333,227,928.60	
Papel Privado					
91	AC	24	AAA(mex)	20,044,063.20	0.42%
91	ACBE	24L	mxAAA	37,813,913.79	0.80%
91	AMX	22	mxAAA	40,166,540.40	0.85%
91	AMX	23-3	mxAAA	15,050,196.45	0.32%
91	ARA	23X	mxAA-	60,279,493.20	1.28%
91	BBPEN	21	AA+(mex)	18,590,365.86	0.39%
91	BWMX	21X	AA(mex)	57,277,582.59	1.22%
91	BWMX	23	AA(mex)	30,141,475.80	0.64%
91	CEMEX	23L	mxAA+	47,681,240.67	1.01%
91	CIRCLEK	22	HR A+	16,105,077.40	0.34%
91	ELEKTRA	22	HR AA	10,016,254.00	0.21%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	15,048,331.05	0.32%
91	FERROMX	21-2	mxAAA	23,418,603.47	0.50%
91	GAP	20	mxAAA	43,297,577.20	0.92%
91	GAP	21	mxAAA	25,252,123.50	0.53%
91	GAP	22L	mxAAA	30,178,047.00	0.64%
91	GAP	23L	mxAAA	20,022,383.40	0.42%
91	GAP	24L	mxAAA	20,057,377.80	0.42%
91	GASA	24	AA+.mx	50,382,999.50	1.07%
91	GCARSO	23	AAA(mex)	65,249,367.30	1.39%

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

¹ El riesgo por invertir en certificados bursátiles fiduciarios o valores respaldados por activos en caso de formar parte de la cartera de inversión del fondo radica en el impacto negativo de movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan directamente al subyacente de los instrumentos adquiridos. El riesgo asociado se considera alto debido a la existencia de riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipo de cambio, inflación entre otros, además de que la liquidez de los instrumentos puede verse afectada negativamente en caso de no existir un mercado secundario desarrollado para los mismos.

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 18/07/2024
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Papel Privado					
91	GCARSO	24	AAA(mex)	50,382,438.50	1.07%
91	GHEMA	23	HR A-	15,058,375.20	0.32%
91	GMFIN	22	mxAAA	25,249,680.37	0.53%
91	GMFIN	23	mxAAA	25,366,651.50	0.54%
91	GPH	22	AAA(mex)	30,251,483.70	0.64%
91	GRUMA	22	mxAA+	40,034,576.80	0.85%
91	HERDEZ	20-2	mxAA	10,092,169.70	0.21%
91	HERDEZ	22-2L	mxAA	28,710,337.70	0.61%
91	HYCSA	24	AA	25,143,439.50	0.53%
91	INVEX	22	mxA+	60,810,650.40	1.29%
91	KOF	20-2	mxAAA	72,473,080.32	1.54%
91	LAB	23	AA+(mex)	50,396,129.50	1.07%
91	LAB	23-2	AA+(mex)	50,489,467.50	1.07%
91	LALA	19-2	AA(mex)	40,385,468.80	0.86%
91	MEGA	22	AAA(mex)	35,077,983.15	0.74%
91	MEGA	24X	AAA(mex)	85,102,531.25	1.81%
91	MONTPIO	21	HR AA+	40,399,410.40	0.86%
91	MONTPIO	23	HR AA+	30,240,782.10	0.64%
91	NAVISTS	22	mxAA+	28,166,059.32	0.60%
91	NAVISTS	24	AAA(mex)	40,184,299.20	0.85%
91	NM	24	mxAA+	75,123,735.75	1.60%
91	OMA	21V	AAA(mex)	15,200,187.00	0.32%
91	OMA	23L	AAA(mex)	30,200,250.90	0.64%
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	70,044,653.70	1.49%
91	SIGMA	24	AAA(mex)	75,384,456.75	1.61%
91	SORIANA	23	AAA(mex)	50,277,508.50	1.07%
91	TIPMXCB	23-2	AAA(mex)	30,230,897.40	0.64%
91	TOYOTA	21	mxAAA	11,530,947.12	0.24%
91	TOYOTA	23	mxAAA	12,543,116.19	0.26%
91	VWLEASE	22-2	mxAAA	30,268,085.40	0.64%

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

¹ El riesgo por invertir en certificados bursátiles fiduciarios o valores respaldados por activos en caso de formar parte de la cartera de inversión del fondo radica en el impacto negativo de movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan directamente al subyacente de los instrumentos adquiridos. El riesgo asociado se considera alto debido a la existencia de riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipo de cambio, inflación entre otros, además de que la liquidez de los instrumentos puede verse afectada negativamente en caso de no existir un mercado secundario desarrollado para los mismos.

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 18/07/2024
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Papel Privado					
91	VWLEASE	24	mxAAA	40,292,930.80	0.86%
				1,871,184,798.00	
91 ¹	ATLASCB	22	HR AAA	30,265,521.30	0.64%
91 ¹	FUTILCB	21	mxAAA	25,102,905.30	0.53%
91 ¹	INVTACB	23	AA-.mx	25,193,420.00	0.53%
91 ¹	VOLARCB	21L	HR AA+	11,341,068.25	0.24%
91 ¹	VOLARCB	23	HR AA+	30,323,519.10	0.64%
				122,226,433.95	
93	ARREACT	00124	F1+(mex)	16,883,105.05	0.36%
93	ARREACT	00624	F1+(mex)	15,012,265.80	0.32%
93	ARREACT	01224	F1+(mex)	15,016,862.55	0.32%
93	RUBA	00224	mxA-1+	15,072,687.45	0.32%
93	TOYOTA	07224	mxA-1+	3,844,355.23	0.08%
				65,829,276.08	
93B	AMX	08324	mxA-1+	14,749,950.45	0.31%
93B	AMX	09124	mxA-1+	14,685,009.75	0.31%
93B	AMX	09524	mxA-1+	19,536,476.20	0.41%
93B	PCARFM	02824	mxA-1+	29,747,567.40	0.63%
				78,719,003.80	
94	BLADEX	24	mxAAA	30,096,874.50	0.64%
				30,096,874.50	
D2P	GS861	240905	BBB+	25,068,642.84	0.53%
				25,068,642.84	
				2,193,125,029.17	

Reportos

IQ	BPAG91	250102	mxAAA	63,234,777.67	1.35%
				63,234,777.67	

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

¹ El riesgo por invertir en certificados bursátiles fiduciarios o valores respaldados por activos en caso de formar parte de la cartera de inversión del fondo radica en el impacto negativo de movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan directamente al subyacente de los instrumentos adquiridos. El riesgo asociado se considera alto debido a la existencia de riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipo de cambio, inflación entre otros, además de que la liquidez de los instrumentos puede verse afectada negativamente en caso de no existir un mercado secundario desarrollado para los mismos.

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 18/07/2024
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Reportos					
LF	BONDESF	270930	mxAAA	200,061,083.32	4.85%
				200,061,083.32	
				263,295,860.99	
CARTERA TOTAL:				4,681,653,076.29	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			0.250 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.0047 %		

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.

¹ El riesgo por invertir en certificados bursátiles fiduciarios o valores respaldados por activos en caso de formar parte de la cartera de inversión del fondo radica en el impacto negativo de movimientos adversos en los factores de riesgo que afectan directamente al subyacente de los instrumentos adquiridos. El riesgo asociado se considera alto debido a la existencia de riesgos implícitos como movimientos de tasas de interés, tipo de cambio, inflación entre otros, además de que la liquidez de los instrumentos puede verse afectada negativamente en caso de no existir un mercado secundario desarrollado para los mismos.