

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 31/01/2025
CALIFICACION: AAAf/S3(mex) F

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
95	CFE	21-4	mxAAA	30,229,097.70	0.59%
95	FNCOT	23S	AAA(mex)	90,365,357.70	1.79%
95	FNCOT	24	AAA(mex)	40,193,583.20	0.79%
95	FNCOT	24-2	AAA(mex)	70,548,889.60	1.39%
				231,336,928.20	
IM	BPAG28	270204	mxAAA	100,430,885.00	1.99%
				100,430,885.00	
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	76,865,509.50	1.52%
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	40,685,012.00	0.80%
IQ	BPAG91	290111	mxAAA	100,113,822.00	1.98%
IQ	BPAG91	290510	mxAAA	50,976,859.00	1.01%
IQ	BPAG91	290913	mxAAA	201,688,302.00	4.67%
				470,329,504.50	
IS	BPA182	280412	mxAAA	25,767,559.75	0.51%
IS	BPA182	290322	mxAAA	31,596,306.60	0.62%
IS	BPA182	300328	mxAAA	30,934,622.70	0.61%
				88,298,489.05	
LF	BONDESF	270114	mxAAA	99,572,628.95	1.97%
LF	BONDESF	270422	mxAAA	19,956,630.20	0.39%
LF	BONDESF	270520	mxAAA	49,882,894.00	0.98%
LF	BONDESF	271014	mxAAA	50,136,313.00	0.99%
LF	BONDESF	271202	mxAAA	199,562,646.01	3.95%
LF	BONDESF	280127	mxAAA	49,822,080.50	0.98%
LF	BONDESF	290419	mxAAA	71,300,041.68	1.41%
LF	BONDESF	290719	mxAAA	99,943,645.00	1.98%
LF	BONDESF	291004	mxAAA	49,655,384.00	0.98%
LF	BONDESF	320415	mxAAA	19,785,608.20	0.39%
				709,617,871.54	

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 utilizando 251 días de historia o escenarios, horizonte temporal de un día y 95% de confianza.

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 31/01/2025
CALIFICACION: AAAf/S3(mex) F

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
LG	BONDESG	270506	AAA(mex)	100,161,688.00	1.98%
				100,161,688.00	
				1,700,175,366.29	
Bancarios					
94	BACOMER	20-2	AAA(mex)	10,078,237.30	0.19%
94	BACTIN	22	AA(mex)	25,065,014.75	0.49%
94	BLADEX	22	mxAAA	30,043,988.10	0.59%
94	BMIFEL	23V	AA+(mex)	34,544,167.50	0.68%
94	COMPART	22S	mxAA	45,455,992.65	0.90%
94	COMPART	24-2S	AA(mex)	50,406,848.00	0.99%
94	COMPART	24S	AA(mex)	35,342,228.95	0.70%
94	CSBANCO	24	A(mex)	30,244,019.70	0.59%
				261,180,496.95	
94F	BSMX	22-3	AAA(mex)	40,153,497.20	0.79%
				40,153,497.20	
CD	BACMEXT	21-2	mxAAA	15,067,426.20	0.29%
CD	BANOB	20-2X	mxAAA	10,058,389.00	0.19%
CD	NAFR	260626	mxAAA	7,271,947.55	0.14%
CD	SHF	21-2	AAA(mex)	10,012,462.30	0.19%
				42,410,225.05	
CDF	BACMEXT	24X	AAA(mex)	30,060,657.30	0.59%
CDF	NAFR	23-3S	mxAAA	15,071,976.60	0.29%
CDF	SHF	23	AAA(mex)	15,052,897.50	0.29%
				60,185,531.40	
F	BBAJIO	24001	F1+(mex)	50,356,400.00	0.99%
				50,356,400.00	
				454,286,150.60	
Papel Privado					
91	AC	24	AAA(mex)	20,063,464.40	0.39%

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 utilizando 251 días de historia o escenarios, horizonte temporal de un día y 95% de confianza.

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 31/01/2025
CALIFICACION: AAAf/S3(mex) F

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Papel Privado					
91	ACBE	24L	mxAAA	37,838,111.65	0.75%
91	AMX	23-3	mxAAA	15,060,898.80	0.29%
91	ARA	23X	mxAA-	60,386,164.80	1.19%
91	BACHOCO	22	AAA(mex)	30,050,208.79	0.59%
91	BBPEN	21	AA+(mex)	18,468,568.77	0.36%
91	BWMX	21X	AA(mex)	72,253,748.41	1.43%
91	BWMX	23	AA(mex)	30,167,227.80	0.59%
91	CEMEX	23L	mxAA+	63,454,224.75	1.25%
91	CIRCLEK	22	HR A+	10,075,393.40	0.19%
91	ELEKTRA	22	HR AA	10,019,372.80	0.19%
91	ELEKTRA	22-3	HR AA	15,049,798.05	0.29%
91	FEMSA	22L	mxAAA	21,680,204.11	0.42%
91	FERROMX	21-2	mxAAA	23,442,925.53	0.46%
91	FORD	24	AA+(mex)	60,469,986.60	1.19%
91	FUTILCB	24S	mxAAA	60,339,216.00	1.19%
91	GAP	20	mxAAA	43,324,532.18	0.85%
91	GAP	21	mxAAA	25,212,395.75	0.49%
91	GAP	22L	mxAAA	30,195,955.80	0.59%
91	GAP	23L	mxAAA	20,044,409.60	0.39%
91	GAP	24	mxAAA	50,362,767.00	0.99%
91	GAP	24L	mxAAA	45,161,787.60	0.89%
91	GASA	24	AA+.mx	65,548,897.05	1.29%
91	GCARSO	23	AAA(mex)	65,299,709.15	1.29%
91	GCARSO	24	AAA(mex)	50,390,031.00	0.99%
91	GMFIN	22	mxAAA	25,004,780.03	0.49%
91	GMFIN	23	mxAAA	25,193,012.50	0.49%
91	GPH	22	AAA(mex)	30,265,221.30	0.59%
91	GRUMA	22	mxAAA	40,265,693.20	0.79%
91	HERDEZ	20-2	mxAA	10,093,054.70	0.20%
91	HERDEZ	22-2L	mxAA	48,885,111.83	0.96%

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 utilizando 251 días de historia o escenarios, horizonte temporal de un día y 95% de confianza.

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 31/01/2025
CALIFICACION: AAAf/S3(mex) F

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Papel Privado					
91	HYCSA	24	HR AA	25,168,448.00	0.49%
91	INVEX	22	mxA+	60,761,428.80	1.20%
91	KOF	20-2	mxAAA	72,005,710.32	1.42%
91	KOF	21-2L	mxAAA	50,350,145.50	0.99%
91	LAB	23	AA+(mex)	50,432,057.50	0.99%
91	LAB	23-2	AA+(mex)	67,297,478.83	1.33%
91	LALA	19-2	AA(mex)	40,356,212.80	0.79%
91	MEGA	22	AAA(mex)	69,905,367.00	1.38%
91	MEGA	24X	AAA(mex)	85,194,542.05	1.68%
91	MOLYMET	24	AAA(mex)	60,498,955.20	1.19%
91	MONTPIO	21	HR AA+	40,053,184.00	0.79%
91	MONTPIO	23	HR AA+	30,263,759.70	0.59%
91	NAVISTS	22	mxAA+	28,201,323.64	0.55%
91	NAVISTS	24	AAA(mex)	40,217,387.60	0.79%
91	NM	24	mxAA+	75,236,473.50	1.49%
91	OMA	21V	AAA(mex)	15,174,771.00	0.30%
91	OMA	23L	AAA(mex)	30,218,384.40	0.59%
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	96,138,957.12	1.90%
91	SIGMA	24	AAA(mex)	75,437,557.50	1.49%
91	SORIANA	23	AAA(mex)	50,327,885.50	0.99%
91	SORIANA	24	AAA(mex)	75,305,406.75	1.49%
91	TIPMXCB	23-2	AAA(mex)	30,365,559.30	0.60%
91	TOYOTA	23	mxAAA	12,548,841.42	0.24%
91	VWLEASE	22-2	mxAAA	30,272,780.40	0.60%
91	VWLEASE	24	mxAAA	40,205,001.60	0.79%
91	VWLEASE	24-3	mxAAA	50,296,279.00	0.99%
				2,426,300,771.78	
91 ¹	ATLASCB	22	HR AAA	22,252,195.80	0.44%
91 ¹	INVTACB	23	AA-.mx	25,060,419.50	0.49%
91 ¹	VOLARCB	21L	HR AA+	23,071,757.00	0.45%

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 utilizando 251 días de historia o escenarios, horizonte temporal de un día y 95% de confianza.

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 31/01/2025
CALIFICACION: AAAf/S3(mex) F

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Papel Privado					
91 ¹	VOLARCB	23	HR AA+	71,161,693.50	1.41%
				141,546,065.80	
93	ARREACT	01224	F1+(mex)	15,033,087.60	0.29%
93	ARREACT	01924	F1+(mex)	20,176,967.60	0.39%
93	RUBA	00125	mxA-1+	18,254,623.66	0.36%
93	RUBA	00824	mxA-1+	11,476,403.74	0.22%
				64,941,082.60	
93B	AMX	00225	mxA-1+	20,842,249.89	0.41%
93B	AMX	00525	mxA-1+	19,034,781.40	0.37%
93B	AMX	12424	mxA-1+	19,791,237.00	0.39%
93B	AMX	12724	mxA-1+	19,753,045.60	0.39%
93B	AMX	15324	mxA-1+	14,902,359.00	0.29%
				94,323,672.89	
94	BLADEX	24	mxAAA	30,143,123.10	0.59%
				30,143,123.10	
				2,757,254,716.17	
Inversión en Divisas					
CHD	EFFECTIV			133,195,751.67	2.64%
				133,195,751.67	
				133,195,751.67	
CARTERA TOTAL:				5,044,911,984.73	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			0.250 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.0132 %		

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 utilizando 251 días de historia o escenarios, horizonte temporal de un día y 95% de confianza.

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.