

CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 27/01/2022
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
IM	BPAG28	240509	mxAAA	94,786,155.00	5.33%
				94,786,155.00	
IQ	BPAG91	220825	mxAAA	40,347,288.80	2.27%
IQ	BPAG91	240829	mxAAA	25,104,596.75	1.41%
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	75,381,573.75	4.24%
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	89,993,363.40	5.06%
				230,826,822.70	
IS	BPA182	280412	mxAAA	81,138,170.40	4.56%
IS	BPA182	280928	mxAAA	30,544,152.00	1.72%
				111,682,322.40	
LD	BONDESD	240530	mxAAA	68,583,680.99	3.86%
LD	BONDESD	240627	mxAAA	49,932,360.00	2.81%
LD	BONDESD	260611	mxAAA	19,849,602.60	1.11%
				138,365,643.59	
				575,660,943.69	
Bancarios					
94	BSMX	18	AAA(mex)	10,025,446.70	0.56%
				10,025,446.70	
CD	BACMEXT	20	mxAAA	20,065,974.00	1.13%
CD	BANOB	20-2X	mxAAA	10,045,857.00	0.56%
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	16,599,442.04	0.93%
CD	NAFR	17S	mxAAA	15,067,656.15	0.84%
CD	SHF	21	AAA(mex)	10,037,053.20	0.56%
CD	SHF	21-2	AAA(mex)	10,055,122.70	0.56%
				81,871,105.09	
				91,896,551.79	
Papel Privado					
91	ACBE	17-2	mxAAA	20,116,485.80	1.13%
91	ARA	21X	AA-	15,044,364.00	0.84%

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 27/01/2022
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Papel Privado					
91	BACHOCO	17	AAA(mex)	11,159,482.22	0.62%
91	BBPEN	21	AAA(mex)	18,567,332.81	1.04%
91	FERROMX	21-2	mxAAA	17,013,434.08	0.95%
91	GAP	20	mxAAA	22,873,416.74	1.28%
91	GAP	20-2	mxAAA	2,467,068.11	0.13%
91	GAP	21	mxAAA	25,158,160.00	1.41%
91	GCARSO	20	AAA(mex)	60,120,466.20	3.38%
91	GMXT	17-2	mxAAA	60,147,555.00	3.38%
91	GPH	19	AAA(mex)	60,021,336.60	3.38%
91	GRUMA	18	mxAA+	12,034,033.80	0.67%
91	HERDEZ	20-2	mxAA	10,031,123.20	0.56%
91	KOF	20-2	mxAAA	59,724,077.40	3.36%
91	LIVEPOL	17-2	mxAAA	64,497,078.76	3.63%
91	MOLYMET	21	AAA(mex)	30,115,682.70	1.69%
91	MONTPIO	21		15,063,868.95	0.84%
91	NM	21	mxAA+	10,045,457.60	0.56%
91	OMA	21V	AAA(mex)	15,018,833.85	0.84%
91	SORIANA	20	AA+(mex)	17,087,808.74	0.96%
91	TOYOTA	21	mxAAA	3,042,534.44	0.17%
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	15,067,051.20	0.84%
				564,416,652.20	
91 ¹	FUTILCB	21	mxAAA	30,144,222.30	1.69%
91 ¹	VOLARCB	21L		4,280,430.68	0.24%
				34,424,652.98	
93	GMFIN	10121	mxA-1+	9,426,750.60	0.53%
93	GMFIN	10421	mxA-1+	10,939,226.60	0.61%
93	GMFIN	10721	mxA-1+	11,202,668.18	0.63%
93	NAVISTS	00222		14,415,079.91	0.81%
93	START	00322		1,539,269.10	0.08%
93	START	05021		15,022,475.10	0.84%

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 27/01/2022
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Papel Privado					
93	TOYOTA	00222	mxA-1+	14,255,579.10	0.80%
93	TOYOTA	02121	mxA-1+	2,900,299.61	0.16%
93	TOYOTA	02321	mxA-1+	15,019,194.30	0.84%
				94,720,542.50	
93B	PCARFM	03721	mxA-1+	10,184,034.67	0.57%
				10,184,034.67	
94	BACOMER	20-2	AAA(mex)	10,042,840.50	0.56%
94	BANORTE	19	mxAAA	20,026,113.00	1.12%
94	BANORTE	19-2	mxAAA	9,122,194.99	0.51%
94	BINBUR	18	mxAAA	10,065,340.80	0.56%
94	BLADEX	19	mxAAA	5,060,770.29	0.28%
94	BLADEX	20	mxAAA	10,097,526.30	0.56%
94	BLADEX	21	mxAAA	15,026,535.90	0.84%
94	COMPART	19	mxAA	14,997,814.95	0.84%
94	SCOTIAB	19	mxAAA	15,073,742.85	0.84%
				109,512,879.58	
95	CFE	21-3	mxAAA	29,698,816.10	1.67%
95	CFE	21-4	mxAAA	30,099,523.50	1.69%
95	FNCOT	19	AAA(mex)	25,090,955.75	1.41%
95	FNCOT	20	AAA(mex)	10,081,995.20	0.56%
95	FNCOT	21G	AAA(mex)	15,091,232.10	0.84%
				110,062,522.65	
CD	BACMEXT	21-2	mxAAA	15,023,859.90	0.84%
CD	BANOB	19	mxAAA	16,024,261.92	0.90%
CD	NAFR	260626	mxAAA	7,235,091.48	0.40%
				38,283,213.30	
				961,604,497.88	

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 27/01/2022
CALIFICACION: AAAf/S4(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Reportos					
LD	BONDESD	240229	mxAAA	146,344,551.62	8.61%
				<u>146,344,551.62</u>	
				<u>146,344,551.62</u>	
CARTERA TOTAL:				1,775,506,544.98	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			0.250 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.0035 %		

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.