

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
Fitch México, S.A. de C.V.
Categoría: Corto Plazo Gubernamental

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Reportos			6,867,206,978	100.00%
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	43,765,495	0.64%
IQ	BPAG91	230831	AAA(mex)	82,200,160	1.20%
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	1,235,694,059	17.99%
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	264,537,148	3.85%
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	301,403,551	4.39%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	500,259,979	7.29%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	301,957,104	4.40%
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	434,600,979	6.33%
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	199,138,352	2.90%
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	1,219,520,333	17.76%
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	1,200,234,319	17.48%
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	165,900,400	2.42%
LD	BONDESD	240627	AAA(mex)	209,464,539	3.05%
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	167,848,756	2.44%
LD	BONDESD	260806	AAA(mex)	340,642,638	4.96%
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	200,039,166	2.91%
	TOTAL CARTERA			6,867,206,978	100.00%
	ACTIVO NETO			6,858,916,716	

Cartera al: 31/05/2022
Límite Máximo de VaR: 0.03%
Var Promedio: 0.0004%
Parámetros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.
Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.
El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.
***De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.**
Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión de Renta Variable
Categoría: Discrecional

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Acciones Industriales Comerciales y de Servicios			92,006,661	57.39%
1	AC	*	Alta	5,619,180	3.51%
1	ALFA	A	Alta	4,989,600	3.11%
1	ALPEK	A	Alta	1,384,360	0.86%
1	ALSEA	*	Alta	2,064,212	1.29%
1	AMX	L	Alta	16,752,050	10.45%
1	BACHOCO	B	Media	5,937,854	3.70%
1	CEMEX	CPO	Alta	12,547,300	7.83%
1	FEMSA	UBD	Alta	17,691,600	11.04%
1	KIMBER	A	Alta	4,418,150	2.76%
1	KOF	UBL	Alta	2,298,855	1.43%
1	LIVEPOL	C-1	Alta	5,193,500	3.24%
1	NEMAK	A	Alta	7,152,000	4.46%
1	ORBIA	*	Alta	898,450	0.56%
1	PE&OLES	*	Alta	3,240,300	2.02%
1	WALMEX	*	Alta	1,819,250	1.14%
	Acciones Referidas a los Títulos Referenciados a Acciones			18,745,200	11.69%
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	18,745,200	11.69%
	Títulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			20,500,480	12.79%
1ISP	EWV	*	Alta	20,500,480	12.79%
	Reportos			29,062,203	18.13%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	29,062,203	18.13%
	TOTAL CARTERA			160,314,543	100.00%
	ACTIVO NETO			160,178,749	
	Cartera al:	31/05/2022			

Límite Máximo de VaR: 6.00%
Var Promedio: 1.2512%
Parámetros: "Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La muestra incluye 500 escenarios para cada uno de los instrumentos en el mercado.
Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.
El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.
***De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana."**
Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión de Renta Variable
Categoría: Discrecional

	Acciones Referidas a los Titulos Referenciados a Acciones			4,441,000	0.91%
1B	GENIUS	21	Media	4,441,000	0.91%
	Acciones Extranjeras de Emisiones Extranjeras			317,812	0.07%
1E	SAN	*	Baja	317,812	0.07%
	Acciones Cotizadas en el SIC (Spot)			7,941,328	1.63%
1ASP	BABA	N	Alta	7,941,328	1.63%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			461,657,377	94.61%
1ISP	ACWI	*	Alta	51,331,162	10.52%
1ISP	ACWX	*	Alta	46,914,484	9.62%
1ISP	DXJ	*	Alta	5,076,497	1.04%
1ISP	EEM	*	Alta	39,031,622	8.00%
1ISP	EUFN	*	Alta	18,280,428	3.75%
1ISP	EWC	*	Alta	3,723,512	0.76%
1ISP	EWI	*	Alta	9,648,060	1.98%
1ISP	EWJ	*	Alta	21,543,811	4.42%
1ISP	EWP	*	Alta	7,596,142	1.56%
1ISP	EZU	*	Alta	31,717,770	6.50%
1ISP	FXI	*	Alta	11,916,421	2.44%
1ISP	GLD	*	Alta	26,951,812	5.52%
1ISP	HEDJ	*	Alta	25,551,287	5.24%
1ISP	IBTA	N	Alta	8,274,209	1.70%
1ISP	IVV	*	Alta	44,918,079	9.21%
1ISP	MCHI	*	Alta	18,351,217	3.76%
1ISP	QQQ	*	Alta	15,171,615	3.11%
1ISP	SHV	*	Alta	37,977,267	7.78%
1ISP	XLE	*	Alta	8,582,878	1.76%
1ISP	XLF	*	Alta	24,438,564	5.01%
1ISP	XLI	*	Alta	4,660,542	0.96%
	Reportos			13,593,994	2.79%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	13,593,994	2.79%
	TOTAL CARTERA			487,951,511	100.00%
	ACTIVO NETO			487,459,082	

Cartera al: 31/05/2022
Límite Máximo de VaR: 7.00%
Var Promedio: 1.1840%
Parámetros: "Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La muestra incluye 500 escenarios para cada uno de los instrumentos en el mercado.
Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.
El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.
***De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana."**
Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

Fitch México, S.A. de C.V.

Categoría: Discrecional Deuda

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados Bursátiles Bancarios				39,896,236	5.44%
94	BINBUR	18	mxAAA	14,102,211	1.92%
94	BLADDEX	21	AAA (mex)	10,747,254	1.47%
94	SCOTIAB	19-2	AAA (mex)	15,046,772	2.05%
Certificados Bursátiles Corporativos				169,730,855	23.16%
91	ACBE	17-2	AAA (mex)	10,399,902	1.42%
91	ATLASCB	22	HR AAA	15,026,745	2.05%
91	BACHOCO	17	AAA (mex)	10,025,163	1.37%
91	DONDE	20	AA/M	9,863,753	1.35%
91	GAP	19	mxAAA	15,117,780	2.06%
91	GMXT	17-2	AAA (mex)	21,093,857	2.88%
91	KOF	17-2	mxAAA	8,009,185	1.09%
91	LIVEPOL	17-2	AAA (mex)	10,010,458	1.37%
91	MOLYMET	21	AAA (mex)	9,799,681	1.34%
91	MONTPIO	21	HR AA+	15,018,125	2.05%
91	NAVISTS	22	mxAA+	15,078,247	2.06%
91	TIPMXCB	20-2	AAA (mex)	15,113,581	2.06%
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	15,174,379	2.07%
Certificados Bursátiles Referenciados a Papel Comercial				18,996,356	2.59%
93	NAVISTS	00122	HR+1	15,077,424	2.06%
93	SENDA	00218	mxD	0	0.00%
93	SENDA	00318	mxD	0	0.00%
93	TOYOTA	01921	F1+ (mex)	3,918,932	0.54%
Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)				37,793,984	5.16%
1ISP	FRMXNX	N	ALTA	28,570,500	3.90%
1ISP	IB1MXX	N	ALTA	9,223,484	1.26%
Udibonos				24,992,994	3.41%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	24,992,994	3.41%
Certif.Burs.Emit. Entidades o Inst.del Gobierno Federal				15,078,463	2.06%
95	FEFA	19V	mxAAA	15,078,463	2.06%
Certificados De La Tesorería De La Federación				306,676,048	41.85%
BI	CETES	220602	AAA(mex)	49,990,195	6.82%
BI	CETES	220630	AAA(mex)	59,663,088	8.14%
BI	CETES	220714	AAA(mex)	39,653,716	5.41%
BI	CETES	221117	AAA(mex)	43,330,928	5.91%
BI	CETES	221215	AAA(mex)	47,804,790	6.52%
BI	CETES	230112	AAA(mex)	37,963,092	5.18%
BI	CETES	230209	AAA(mex)	28,270,239	3.86%
Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija				61,253,886	8.36%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	47,195,554	6.44%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	14,058,332	1.92%
Reportos				58,457,753	7.98%
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	49,583,313	6.77%
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	8,874,441	1.21%
TOTAL CARTERA				732,876,575	100.00%
ACTIVO NETO				732,642,363	
Cartera al:		31/05/2022			

Límite Máximo de VaR: 0.57%
Var Promedio: 0.1070%

Parámetros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda

Fitch México, S.A. de C.V.

Categoría: Discrecional en Gubernamental

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Udibonos			55,353,666	21.49%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	10,773,500	4.18%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	33,581,341	13.04%
S	UDIBONO	401115	AAA(mex)	10,998,825	4.27%
	Certificados De La Tesorería De La Federación			48,510,505	18.83%
BI	CETES	220714	AAA(mex)	24,783,573	9.62%
BI	CETES	230112	AAA(mex)	23,726,933	9.21%
	Bonos del Gob. Fed. Tasa Fija			33,776,045	13.11%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	19,717,713	7.65%
M	BONOS	421113	AAA(mex)	14,058,332	5.46%
	Reportos			119,984,633	46.57%
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	119,984,633	46.57%
	TOTAL CARTERA			257,624,849	100.00%
	ACTIVO NETO			253,948,011	
	Cartera al:	31/05/2022			

Límite Máximo de VaR: 1.76%
Var Promedio: 0.2861%

Parámetros: "Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día. El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
Fitch México, S.A. de C.V.
Categoría: Corto Plazo

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados De La Tesorería De La Federación				1,686,558,230	34.47%
BI	CETES	220602	AAA(mex)	409,919,599	8.38%
BI	CETES	220609	AAA(mex)	44,042,734	0.90%
BI	CETES	220616	AAA(mex)	149,565,630	3.06%
BI	CETES	220630	AAA(mex)	34,803,468	0.71%
BI	CETES	220714	AAA(mex)	69,386,072	1.42%
BI	CETES	220825	AAA(mex)	294,711,570	6.02%
BI	CETES	220908	AAA(mex)	97,927,750	2.00%
BI	CETES	221006	AAA(mex)	68,090,456	1.39%
BI	CETES	221117	AAA(mex)	356,276,515	7.28%
BI	CETES	221215	AAA(mex)	66,926,706	1.37%
BI	CETES	230112	AAA(mex)	94,907,730	1.94%
Bonos De Desarrollo Del Gobierno Federal				50,191,821	1.03%
LD	BONDESD	220707	AAA(mex)	50,191,821	1.03%
Reportos				3,155,555,824	64.50%
IQ	BPAG91	230427	AAA(mex)	840,693,025	17.18%
LD	BONDESD	241024	AAA(mex)	498,852,516	10.20%
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	499,057,082	10.20%
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	498,004,741	10.18%
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	321,026,459	6.56%
LD	BONDESD	260611	AAA(mex)	497,922,001	10.18%
TOTAL CARTERA				4,892,305,875	100.00%
ACTIVO NETO				4,887,972,630	

Cartera al: 31/05/2022
Límite Máximo de VaR: 0.80%
Var Promedio: 0.0060%

Parámetros: "Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La muestra incluye 500 escenarios para cada uno de los instrumentos en el mercado. Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día. El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana. *De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que las sociedades de inversión de renta variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana."

Límite autorizado por CNBV

Fondos de Inversión en Instrumentos de Deuda
Fitch México, S.A. de C.V.
Categoría: Corto Plazo Moneda Extranjera

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Certificados de Depósito (Tipo de Cambio Spot)				1,083,478,256	39.91%
FSP	BACMEXT	D22002	F1+ (mex)	98,528,217	3.63%
FSP	BACMEXT	D22004	F1+ (mex)	137,908,110	5.08%
FSP	NAFIN	D22003	F1+ (mex)	78,892,198	2.91%
FSP	NAFIN	D22007	F1+ (mex)	78,821,835	2.90%
FSP	NAFIN	D22009	F1+ (mex)	78,818,307	2.90%
FSP	NAFIN	D22010	F1+ (mex)	59,112,156	2.18%
FSP	NAFIN	D22011	F1+ (mex)	137,880,914	5.08%
FSP	NAFIN	D22012	F1+ (mex)	137,858,779	5.08%
FSP	NAFIN	D22013	F1+ (mex)	137,828,841	5.08%
FSP	NAFIN	D22014	F1+ (mex)	137,828,898	5.08%
Chequera Dolares				1,631,076,295	60.09%
CHD	40-002	9409199	N/A	590,565,000	21.76%
CHD	40-012	6539459	N/A	449,866,726	16.57%
CHD	40-044	0941285	N/A	590,644,569	21.76%
TOTAL CARTERA				2,714,554,551	100.00%
ACTIVO NETO				2,713,469,735	

Cartera al: 31/05/2022
Límite Máximo de VaR: 2.50%
Var Promedio: 1.1394%

Parámetros: Valor en riesgo (VaR). El método utilizado es simulación histórica. La matriz incluye 500 escenarios de pérdida para cada uno de los instrumentos en el mercado.

Se valúa el portafolio con cada uno de los escenarios y se ordenan los resultados de menor a mayor obteniendo el 26avo peor el cual corresponde al VaR al 95% de confianza y un horizonte temporal de VaR de 1 día.

El VaR que se presenta es el promedio simple de la última semana.

*De acuerdo a lo establecido en la Circular Única de Fondos de Inversión, en su artículo 136 la cual señala que los Fondos Inversión de Renta Variable y en instrumentos de deuda deberán mantener a disposición del público, a través de la página electrónica en la red mundial (Internet) de las sociedades o entidades que les presten el servicio de distribución de sus acciones un informe que contenga la composición de su cartera de inversión, el cual deberá actualizarse el último día hábil de cada semana.

Límite autorizado por CNBV